
朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:朱雀基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月13日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本中期报告摘要摘自中期报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读中期报告正文。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	10
2.4 信息披露方式	10
2.5 其他相关资料	10
§3 主要财务指标和基金净值表现	11
3.1 主要会计数据和财务指标	11
3.2 基金净值表现	12
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 中期财务会计报告(未经审计)	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	21
6.4 报表附注	23
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金	
基金简称	朱雀安鑫回报	
基金主代码	008469	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年03月18日	
基金管理人	朱雀基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	981,395,117.27份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	朱雀安鑫回报A	朱雀安鑫回报C
下属分级基金的交易代码	008469	008470
报告期末下属分级基金的份额总额	886,578,048.11份	94,817,069.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>基金管理人基于对宏观经济和货币政策分析，密切关注市场波动动态调整宏观逻辑，探究市场主要矛盾，在严格控制风险的前提下，运用多种价值增值策略，同时充分发挥公司权益方面的投资优势，自上而下的评价类属资产的风险收益比，挖掘相对价值较高的资产，确定债券股票大类资产配置以及交易趋势，追求绝对收益。具体而言，本基金的投资策略主要包括：大类资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略等。</p> <p>1、 大类资产配置策略</p> <p>本基金对宏观经济政策及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾宏观经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，在对证券市场当期</p>

的系统性风险及各类资产的预期风险收益进行充分分析的基础上，合理调整债券资产、股票资产和其他金融工具的投资权重，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险控制，适时地做出相应调整。

2、 债券投资策略

(1) 买入持有策略

以简单、低交易成本为原则，挑选符合投资需求的标的债券，持有到期后再转而投资新的标的债券。

(2) 久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

(3) 收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益曲线形状变化的预测，确定采用子弹型策略、哑铃型策略和梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(4) 板块轮换策略

根据国债、金融债、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持相对低估的板块，减持相对高估的板块，借以取得较高收益。

(5) 骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着所持有债券的剩余期限下降，债券的到期收益率将下降，从而获得资本利得。

(6) 个券选择策略

用自下而上的方法选择价值相对低估的债券。通过考察收益率曲线的相对位置和形状，对比不同信用等级、在不同市场交易债券的到期收益率等方法，结合票息、税收、可否回购、嵌入期权等其他决定债券价值的因素，从而发现市场中个券的价值相对低估状

况。

(7) 信用债投资策略

本基金通过研判宏观经济走势、债券发行主体所处行业周期及其财务状况，对其信用风险进行审慎度量 and 定价，分析其收益率相对于信用风险的投资价值，并结合流动性状况综合考虑，选择信用利差溢价较高且不失流动性的品种进行投资。在对债券发行主体行业周期的判断上，本基金将借助权益研究力量，通过公司产业链投研体系对行业周期进行判断，并重点关注产业链上相关公司债券的投资机会。

(8) 可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券同时具有债券与权益类证券的双重特性。本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券和可交换债券的特性选择各行业不同的券种。本基金利用可转换债券及可交换债券的债券底价和到期收益率来判断其债性，增强本金投资的相对安全性；利用可转换债券及可交换债券的溢价率来判断其股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

(9) 证券公司短期公司债券投资策略

对于证券公司短期公司债券，本基金对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，综合考虑和分析发行主体的公司背景、竞争地位 治理结构、盈利能力、偿债能力、债券收益率等要素，确定投资决策。本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，并适当控制债券投资组合整体的久期，防范流动性风险。

3、 股票投资策略

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。在此基础上，本基金还将通过精选具有长期投资价值的股票，以获取股票市场的投资收益，通过权益投资增强本基金的投资回报。具体而言，本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理念，在宏观策略研究基础上，把握结构性调整机会，将行业分析与个

股精选相结合，寻找具有投资潜力的细分行业和个股。

（1）自上而下的行业遴选

本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业盈利前景和产业政策要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业盈利前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等；对于产业政策要素，主要分析国家产业发展方向、政策扶持力度等因素，选择符合高标准市场经济要求的行业。

（2）自下而上的个股选择

本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的上市公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得国际竞争力或者在国内市场具备难以复制的优势。另一方面是管理层分析，通过对公司管理层及公司治理结构的分析选择治理结构完善、管理层勤勉尽职的上市公司。

（3）综合研判

本基金在自上而下和自下而上的基础上，结合估值分析，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的保值增值。通过对绝对估值、相对估值方法的选择和综合研判，选择股价相对低估的股票。就相对估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和成长性分析，确定具有上升基础的股价水平。就绝对估值方法而言，基于行业和公司商业模式的特点，确定关键估值方法，包括股息贴现模型（DDM）、现金流贴现模型（DCF模型）、股权自由现金流贴现模型（FCFE模型）、

	<p>公司自由现金流贴现模型（FCFF模型）等。</p> <p>（4）港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将遵循上述股票投资策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。</p> <p>（5）存托凭证策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>4、 国债期货投资策略</p> <p>在风险可控的前提下，本基金将本着谨慎原则适度参与国债期货投资。本基金参与国债期货交易以套期保值为主要目的，运用国债期货对冲风险。本基金将根据对债券现货市场和期货市场的分析，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，发挥国债期货杠杆效应和流动性较好的特点，灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲收益率曲线平坦、陡峭等形态变化的风险、对冲关键期限利率波动的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>5、 资产支持证券投资策略</p> <p>对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，采用基本面分析和数量化模型相结合的方法对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。</p>
业绩比较基准	<p>中债新综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深300指数收益率*5%+恒生指数收益率*5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%</p>
风险收益特征	<p>本基金为债券型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承</p>

	<p>担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> <p>本基金可投资于科创板上市的股票，除了需要承担与证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临投资科创板股票的特殊风险，本基金投资科创板的风险详见招募说明书。</p>
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	朱雀基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢琮
	联系电话	021-20305803
	电子邮箱	xiecong@rosefinch.cn
客户服务电话	400-921-7211	95561
传真	021-20305999	021-62535823
注册地址	西安经济技术开发区草滩生态产业园尚稷路8号一栋二楼	福州市湖东路154号
办公地址	上海市浦东新区海阳西路555号/东育路588号前滩中心(前滩荟)第58层	上海市银城路167号
邮政编码	201204	200041
法定代表人	梁跃军	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.rosefinchfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	朱雀基金管理有限公司	上海市浦东新区海阳西路555号/ 东育路588号前滩中心（前滩荟） 第58层
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路222号外滩 中心30楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	朱雀安鑫回报A	朱雀安鑫回报C
本期已实现收益	26,632,451.98	3,850,155.54
本期利润	17,469,158.90	2,508,614.52
加权平均基金份额本期利润	0.0214	0.0232
本期加权平均净值利润率	1.91%	2.08%
本期基金份额净值增长率	2.89%	2.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	74,536,437.83	7,660,766.49
期末可供分配基金份额利润	0.0841	0.0808
期末基金资产净值	1,006,006,343.92	107,274,176.70
期末基金份额净值	1.1347	1.1314
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长	13.47%	13.14%

率		
---	--	--

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

朱雀安鑫回报A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.57%	0.14%	0.02%	0.08%	0.55%	0.06%
过去三个月	2.90%	0.19%	1.33%	0.09%	1.57%	0.10%
过去六个月	2.89%	0.34%	2.21%	0.12%	0.68%	0.22%
过去一年	11.77%	0.29%	4.58%	0.11%	7.19%	0.18%
自基金合同生效起至今	13.47%	0.27%	5.75%	0.13%	7.72%	0.14%

朱雀安鑫回报C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.55%	0.14%	0.02%	0.08%	0.53%	0.06%
过去三个月	2.83%	0.19%	1.33%	0.09%	1.50%	0.10%
过去六个月	2.74%	0.34%	2.21%	0.12%	0.53%	0.22%
过去一年	11.45%	0.29%	4.58%	0.11%	6.87%	0.18%
自基金合同生效起至今	13.14%	0.27%	5.75%	0.13%	7.39%	0.14%

注：本基金业绩比较基准为：中债新综合财富（总值）指数收益率*85% + 沪深 300 指数收益率*5%+恒生指数收益率*5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

朱雀安鑫回报A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年03月18日-2021年06月30日)



朱雀安鑫回报C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年03月18日-2021年06月30日)



注：本基金建仓期为本基金合同生效之日起 6 个月。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

朱雀基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2018】1496号文批准，并于2018年10月25日成立，其中朱雀股权投资管理有限公司出资占注册资本的65%，上海朱雀辛酉投资中心（有限合伙）出资占注册资本的35%。2019年3月28日，朱雀基金股东同比例增加出资额，注册资本变更为壹亿伍仟万元人民币。

截至2021年6月30日，公司旗下共管理着7只基金，分别为朱雀产业臻选混合型证券投资基金、朱雀产业智选混合型证券投资基金、朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金、朱雀企业优胜股票型证券投资基金、朱雀企业优选股票型证券投资基金、朱雀匠心一年持有期混合型证券投资基金、朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳雯青	公募投资部固收投资总监 /基金经理	2020-03-18	-	15	柳雯青，金融学硕士。先后任职于兴业银行股份有限公司，富国基金管理有限公司。现任公司公募投资部固收投资总监，担任朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。

注：

- 1、“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在防范投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

统计相同投资策略的组合过去连续4个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3和T=5）存在同向交易价差的样本，并对溢价率均值、溢价率标准差、交易占优比、t值等指标进行分析，未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

对于上半年来说，影响债券市场的最大主线就是流动性超预期宽松，虽然中间受到经济复苏、通胀压力等影响，但地方债供给发行缓慢，房地产和地方政府融资受到严格限制，导致市场一直担忧的流动性紧张迟迟未能兑现，机构表现欠配，而7月份的意外降准更是加剧了这种情况，上半年收益率整体呈现下行态势。股票方面，春节之后由通胀预期及美债收益率上行等自上而下因素引发的调整，接力了年季报披露对基本面的重新审视。一度完全抹去了 2020 年底以来的全部涨幅，消化了获利盘，部分弥合了行业之间的估值分化。成交量等反应市场情绪的指标处在低位，股票分母和分子的风险均有所消化，但行业分化的格局进一步加剧。

操作方面，债券方面，考虑到市场对通胀预期的反应较为充分，同时央行多次表达以稳为主的基调，宽松的资金面稳定了市场恐慌情绪，但在经济复苏、海外政策扰动的情況下，货币政策也很难有进一步宽松，因此短端利率的下行空间较为有限，在收益率曲线呈现陡峭化的情况下，主要做了期限结构的调整，增加了久期配置。股票方面，考虑到流动性难有新的突破，因此小幅度降低了仓位，并做了结构上的调整。由于港股大

型科技公司受反垄断调查的影响调整较大，我们判断短期内虽然会造成基本面的压力，但中长期将更有利于大型科技的发展，而大型科技公司的创新优势在不断强化，新业务蒸蒸日上，未来空间更为广阔，因此小幅度进行了增持，对光伏产业链上的品种进行了结构调整，减持了上游偏周期的品种，增持了偏下游的个股。另外在医药生物、汽车、消费等领域也作了布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末朱雀安鑫回报A基金份额净值为1.1347元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.89%，同期业绩比较基准收益率为2.21%；截至报告期末朱雀安鑫回报C基金份额净值为1.1314元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.74%，同期业绩比较基准收益率为2.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着经济复苏动能的逐渐转弱和基数效应的衰减，疫后经济复苏的最高点可能已经在今年上半年显现，目前市场对今年经济“前高后低”走势判断较为一致，但一方面房地产表现韧性，消费和制造业投资仍在修复，对经济增长形成一定支撑，另一方面，财政空间较大，地方债发行和财政支出上半年都未发力，可以充分发挥基建托底作用。流动性方面，在央行以稳为主，更多关注稳杠杆和防风险的框架下，预计还会保持流动性合理充裕，而从宏观资金供求结构来看，虽然地方债的发行仍存一定压力，但在信用风险加大的情况下，利率债的配置需求也有望提升，从当前期限利差来看，中长期利率债仍有优势。下半年还是以久期和票息策略为主，在上行幅度较大的情况下可着重把握交易机会。

股票方面，首先在货币政策以稳为主的背景下，A股市场不存在大的系统性风险。而面对当前经济结构转型，也带来了不同行业间迅速的此消彼长，估值极致分化或成为常态。在此背景下，资产配置的逻辑也从宏观总量驱动下沉到产业和赛道驱动。在3060目标下，光伏、储能和氢能是三个主要方向，其中作为主路线的光伏行业过去10年增长10倍（最好的公司收入增长100倍），目前看未来行业或许还有至少较大空间，而且涉及诸多子行业，并日益进入产业链，有望成为地产基建的有效替代，这也将是我们重点布局领域。此外，自主创新提升了半导体、航天航空等领域的政策支持和发展空间的确 定性，消费电子厚积薄发有望在智能车供应链领域地位提升，这些行业的龙头公司保持着旺盛的生命力，并有望长期保持显著高于中国经济增速的ROE水平。公司在光伏、新能源车领域已有长期布局，因此将在这些生态圈进一步发挥自身优势。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，公司估值委员会成员包括公司总经理、督察长、监察稽核部负责人、研究部负责人、固定收益负责人、基金运营部负责人等相关专业人士组成。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议、经公司总经理办公会审议批准后执行。在每个估值日，本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，兴业银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

兴业银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

兴业银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,843,557.45	876,358.62
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,093,990,959.20	644,437,395.53
其中：股票投资		110,828,065.72	76,607,747.65
基金投资		-	-
债券投资		983,162,893.48	567,829,647.88
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	9,907,487.15	9,947,892.03
应收股利		28,062.65	-
应收申购款		367,381.91	10,350,809.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,115,137,448.36	665,612,455.54

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	45,959,760.06
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,085,622.21	1,410,743.51
应付管理人报酬		536,489.28	285,985.48
应付托管费		89,414.90	47,664.25
应付销售服务费		27,319.05	26,084.90
应付交易费用	6.4.7.7	1,925.00	5,743.50
应交税费		41,693.69	12,068.47
应付利息		-	13,141.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	74,463.61	130,673.53
负债合计		1,856,927.74	47,891,864.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	981,395,117.27	560,265,206.81
未分配利润	6.4.7.10	131,885,403.35	57,455,383.76
所有者权益合计		1,113,280,520.62	617,720,590.57
负债和所有者权益总计		1,115,137,448.36	665,612,455.54

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额981,395,117.27份，其中A类基金份额净值人民币1.1347元，份额总额886,578,048.11份；C类基金份额净值人民币1.1314元，份额总额94,817,069.16份。

6.2 利润表

会计主体：朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年03月18日(基金 合同生效日)至2020 年06月30日
一、收入		24,992,987.27	11,493,920.59
1. 利息收入		15,954,146.68	5,243,634.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	63,154.64	162,609.07
债券利息收入		15,890,992.04	4,952,229.79
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	128,795.34
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		19,493,123.57	1,210,804.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,935,192.64	631,696.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,228,144.21	76,568.15
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	329,786.72	502,539.85
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,504,834.10	5,034,688.14
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	50,551.12	4,793.76
减：二、费用		5,015,213.85	2,121,702.22

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,084,005.38	1,071,400.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	514,000.98	178,566.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	180,124.37	162,096.20
4. 交易费用	6.4.7.19	378,877.04	119,819.98
5. 利息支出		731,034.13	516,973.77
其中：卖出回购金融资产支出		731,034.13	516,973.77
6. 税金及附加		21,192.35	13,597.73
7. 其他费用	6.4.7.20	105,979.60	59,247.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,977,773.42	9,372,218.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,977,773.42	9,372,218.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	560,265,206.81	57,455,383.76	617,720,590.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,977,773.42	19,977,773.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值	421,129,910.46	54,452,246.17	475,582,156.63

变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	627,723,728.12	78,015,063.19	705,738,791.31
2. 基金赎回款	-206,593,817.66	-23,562,817.02	-230,156,634.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	981,395,117.27	131,885,403.35	1,113,280,520.62
项 目	上年度可比期间 2020年03月18日(基金合同生效日)至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	624,649,126.93	-	624,649,126.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,372,218.37	9,372,218.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-23,149,038.82	-205,281.55	-23,354,320.37
其中: 1. 基金申购款	30,615,504.11	324,493.74	30,939,997.85
2. 基金赎回款	-53,764,542.93	-529,775.29	-54,294,318.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益	601,500,088.11	9,166,936.82	610,667,024.93

(基金净值)			
--------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

梁跃军

赵霞

樊安

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人朱雀基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2019]2407号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为624,649,126.93份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(20)第00069号的验资报告。基金合同于2020年3月18日生效。本基金的基金管理人为朱雀基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定,本基金份额分为A类基金份额(以下简称“朱雀安鑫回报A”)和C类基金份额(以下简称“朱雀安鑫回报C”)两类份额。其中,朱雀安鑫回报A是指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;朱雀安鑫回报C是指在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、国债期货、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其

中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富(总值)指数收益率 \times 85%+沪深300 指数收益率 \times 5%+恒生指数收益率 \times 5%+金融机构人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及自2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转入、转出、类别调整等引起的基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利

息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可根据实际情况进行收益分配，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；A类和C类基金份额持有人可分别选择不同的分红方式；同一投资者持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式；

3) 基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、

深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
活期存款	66,952.49	
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	10,776,604.96	
合计	10,843,557.45	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	101,378,573.04	110,828,065.72	9,449,492.68	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	314,662,042.12	317,233,393.48	2,571,351.36
	银行间市场	659,008,358.48	665,929,500.00	6,921,141.52
	合计	973,670,400.60	983,162,893.48	9,492,492.88
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	1,075,048,973.64	1,093,990,959.20	18,941,985.56
----	------------------	------------------	---------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	30.06
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,665.36
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	9,883,870.61
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	21,921.12
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	9,907,487.15

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	1,925.00
合计	1,925.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	79.85
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	14,876.39
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	74,463.61

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 朱雀安鑫回报A

金额单位：人民币元

项目 (朱雀安鑫回报A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	464,449,887.46	464,449,887.46
本期申购	565,813,852.78	565,813,852.78
本期赎回(以“-”号填列)	-143,685,692.13	-143,685,692.13
本期末	886,578,048.11	886,578,048.11

6.4.7.9.2 朱雀安鑫回报C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(朱雀安鑫回报C)	2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	95,815,319.35	95,815,319.35
本期申购	61,909,875.34	61,909,875.34
本期赎回(以“-”号填列)	-62,908,125.53	-62,908,125.53
本期末	94,817,069.16	94,817,069.16

注：1. 本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 朱雀安鑫回报A

单位：人民币元

项目 (朱雀安鑫回报A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,134,664.00	26,623,517.54	47,758,181.54
本期利润	26,632,451.98	-9,163,293.08	17,469,158.90
本期基金份额交易产生的变动数	26,769,321.85	27,431,633.52	54,200,955.37
其中：基金申购款	36,683,105.95	33,644,145.27	70,327,251.22
基金赎回款	-9,913,784.10	-6,212,511.75	-16,126,295.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,536,437.83	44,891,857.98	119,428,295.81

6.4.7.10.2 朱雀安鑫回报C

单位：人民币元

项目 (朱雀安鑫回报C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,209,965.81	5,487,236.41	9,697,202.22
本期利润	3,850,155.54	-1,341,541.02	2,508,614.52
本期基金份额交易产生的变动数	-399,354.86	650,645.66	251,290.80
其中：基金申购款	3,786,505.15	3,901,306.82	7,687,811.97
基金赎回款	-4,185,860.01	-3,250,661.16	-7,436,521.17

本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,660,766.49	4,796,341.05	12,457,107.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
活期存款利息收入	4,593.11	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	36,640.41	
结算备付金利息收入	-	
其他	21,921.12	
合计	63,154.64	

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
卖出股票成交总额	118,445,575.85	
减：卖出股票成本总额	100,510,383.21	
买卖股票差价收入	17,935,192.64	

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,228,144.21	
债券投资收益——赎回差价收入	-	
债券投资收益——申购差价收入	-	
合计	1,228,144.21	

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	456,933,595.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	450,791,656.23
减：应收利息总额	4,913,795.29
买卖债券差价收入	1,228,144.21

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	329,786.72
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	329,786.72

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-10,504,834.10
——股票投资	-12,254,665.33
——债券投资	1,749,831.23
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允	-

价值变动产生的预估增值税	
合计	-10,504,834.10

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	45,820.76
转换费收入	4,730.36
合计	50,551.12

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	371,002.04
银行间市场交易费用	7,875.00
合计	378,877.04

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	15,065.84
账户维护费-中债登	9,000.00
账户维护费-上清所	7,530.00
合计	105,979.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
朱雀基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,084,005.38	1,071,400.65
其中：支付销售机构的客户维护费	381,573.87	339,036.05

注：支付基金管理人朱雀基金的基金管理费按前一日基金资产净值×0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同生 效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	514,000.98	178,566.74

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	朱雀安鑫回报A	朱雀安鑫回报C	合计
兴业银行	0.00	53,224.07	53,224.07

股份有限公司			
朱雀基金管理 有限公司	0.00	32,907.36	32,907.36
合计	0.00	86,131.43	86,131.43
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	朱雀安鑫回报A	朱雀安鑫回报C	合计
兴业银行 股份有限 公司	0.00	76,719.79	76,719.79
朱雀基金 管理有限 公司	0.00	497.53	497.53
合计	0.00	77,217.32	77,217.32

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按基金前一日基金资产净值×0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：朱雀安鑫回报C的日销售服务费=前一日朱雀安鑫回报C基金资产净值×0.30%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未发生与通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未发生与通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

朱雀安鑫回报A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年06 月30日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金 合同生效日）至2020年0 6月30日
基金合同生效日（2020年03月18日）持有的基金份额	9,000,000.00	9,000,000.00
报告期初持有的基金份额	9,000,000.00	9,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	9,000,000.00	9,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.02%	2.03%

朱雀安鑫回报C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年06 月30日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金 合同生效日）至2020年0 6月30日
基金合同生效日（2020年03月18日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00

报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同生效日） 至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	66,952.49	4,593.11	915,326.50	66,052.86

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发而于期末持有的流通受限股票。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币15,999,840.00元，于2021年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规、中国证监会规定和公司各项规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；建立符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，确保公司经营管理目标和发展战略的实现；建立行之有效的风险控制机制。在有效控制风险的前提下，确保基金持有人利益最大化，并保证基金持有人的合法权益不受侵犯。强化风险管理、防范各类风险，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整，实现公司稳健、持续发展，维护股东权益，维护公司信誉，树立良好的公司形象，及时高效地配合监管部门工作。

在董事会领导下，本基金管理人建立了架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。公司风险控制体系由公司董事会、合规风控委员会、督察长、管理层、风险控制委员会、监察稽核部和各风险控制部门组成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用资质降低导致债券价格下降的风险，也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

本基金管理人计划投资于具有良好信用等级的证券，且通过控制不同等级债券的投资比例以分散信用风险。公司建立了内部评级体系和交易对手库，对信用债券库内品种进行动态跟踪和整体回顾，对交易对手库进行日常维护和监控，并根据实际情况及时做出调整，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	60,036,000.00	19,975,997.40
合计	60,036,000.00	19,975,997.40

注：未评级债券为债券期限在1年以内的国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	374,539,300.00	163,326,307.80
AAA以下	31,094,357.68	47,003,629.28
未评级	517,493,235.80	337,523,713.40
合计	923,126,893.48	547,853,650.48

注：未评级债券为债券期限在1年以上的国债、政策性金融债等无信用评级债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期内无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存	10,843,557.4	-	-	-	-	-	10,843,557.45

朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金 2021 年中期报告

款	5						
交易性金融资产	-	-	105,262,500.00	413,777,300.00	464,123,093.48	110,828,065.72	1,093,990,959.20
应收利息	-	-	-	-	-	9,907,487.15	9,907,487.15
应收股利	-	-	-	-	-	28,062.65	28,062.65
应收申购款	1,000.00	-	-	-	-	366,381.91	367,381.91
资产总计	10,844,557.45	-	105,262,500.00	413,777,300.00	464,123,093.48	121,129,997.43	1,115,137,448.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,085,622.21	1,085,622.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	536,489.28	536,489.28
应付托管费	-	-	-	-	-	89,414.90	89,414.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	27,319.05	27,319.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,925.00	1,925.00
应交税费	-	-	-	-	-	41,693.69	41,693.69
其他负债	-	-	-	-	-	74,463.61	74,463.61
负债总计	-	-	-	-	-	1,856,927.74	1,856,927.74
利率敏感度缺口	10,844,557.45	-	105,262,500.00	413,777,300.00	464,123,093.48	119,273,069.69	1,113,280,520.62
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	876,358.62	-	-	-	-	-	876,358.62
交易性金融资产	-	-	40,146,030.60	286,865,900.00	240,817,717.28	76,607,747.65	644,437,395.53
应收利息	-	-	-	-	-	9,947,892.03	9,947,892.03
应收申购款	9,999,000.00	-	-	-	-	351,809.36	10,350,809.36
资产总计	10,875,358.62	-	40,146,030.60	286,865,900.00	240,817,717.28	86,907,449.04	665,612,455.54

负债							
卖出回购金融资产款	45,959,820.06	-	-	-	-	-	45,959,820.06
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,410,743.51	1,410,743.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	285,985.48	285,985.48
应付托管费	-	-	-	-	-	47,664.25	47,664.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	26,084.90	26,084.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,743.50	5,743.50
应交税费	-	-	-	-	-	12,068.47	12,068.47
应付利息	-	-	-	-	-	13,141.27	13,141.27
其他负债	-	-	-	-	-	130,673.53	130,673.53
负债总计	45,959,820.06	-	-	-	-	1,932,104.91	47,891,924.97
利率敏感度缺口	-35,084,461.44	-	40,146,030.60	286,865,900.00	240,817,717.28	84,975,344.13	617,720,530.57

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-12,873,033.95	-7,218,912.77
	市场利率下降25个基点	13,547,061.08	7,391,058.20

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	30,286,667.7 5	-	30,286,667.7 5
应收股利	-	28,062.65	-	28,062.65
资产合计	-	30,314,730.4 0	-	30,314,730.4 0
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	30,314,730.4 0	-	30,314,730.4 0
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	28,764,187.4 2	-	28,764,187.4 2
资产合计	-	28,764,187.4 2	-	28,764,187.4 2
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	28,764,187.4 2	-	28,764,187.4 2

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额

		额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	1,515,736.52	1,438,209.37
	所有外币相对人民币贬值5%	-1,515,736.52	-1,438,209.37

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	110,828,065.72	9.96	76,607,747.65	12.40
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	983,162,893.48	88.31	567,829,647.88	91.92
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	1,093,990,959.20	98.27	644,437,395.53	104.33
----	------------------	-------	----------------	--------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	5,434,117.93	4,381,616.53
	业绩比较基准下降5%	-5,434,117.93	-4,381,616.53

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币116,799,923.40元，属于第二层次的余额为人民币977,191,035.80元，属于第三层次的余额为人民币0元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	110,828,065.72	9.94
	其中：股票	110,828,065.72	9.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	983,162,893.48	88.17
	其中：债券	983,162,893.48	88.17
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,843,557.45	0.97
8	其他各项资产	10,302,931.71	0.92
9	合计	1,115,137,448.36	100.00

注：权益投资中港股通股票公允价值为30,286,667.75元，占基金总资产比例2.72%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	43,623,230.75	3.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,020,739.00	0.27
E	建筑业	6,753,040.00	0.61
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,378,962.70	0.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,276,882.80	0.47
J	金融业	8,507,830.00	0.76
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,674,602.72	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,306,110.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	80,541,397.97	7.23

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
基础材料	2,644,683.07	0.24
非日常生活消费品	7,599,303.43	0.68
日常消费品	3,366,179.64	0.3
金融	2,454,902.27	0.22
医疗保健	3,126,811.03	0.28
信息技术	5,117,791.25	0.46
电信服务	5,976,997.06	0.54
合计	30,286,667.75	2.72

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	---------	---------------

1	600036	招商银行	157,000	8,507,830.00	0.76
2	002352	顺丰控股	110,871	7,505,966.70	0.67
3	603098	森特股份	173,600	6,753,040.00	0.61
4	300433	蓝思科技	228,400	6,717,244.00	0.60
5	H00700	腾讯控股	12,300	5,976,997.06	0.54
6	600893	航发动力	102,000	5,425,380.00	0.49
7	H03690	美团-W	19,500	5,198,669.42	0.47
8	H01810	小米集团-W	227,800	5,117,791.25	0.46
9	002311	海大集团	50,900	4,153,440.00	0.37
10	600438	通威股份	94,600	4,093,342.00	0.37
11	H00291	华润啤酒	58,000	3,366,179.64	0.30
12	002050	三花智控	136,600	3,275,668.00	0.29
13	H01801	信达生物	41,500	3,126,811.03	0.28
14	002267	陕天然气	439,700	3,020,739.00	0.27
15	688289	圣湘生物	28,508	2,835,120.60	0.25
16	688568	中科星图	43,168	2,762,752.00	0.25
17	688057	金达莱	85,396	2,674,602.72	0.24
18	H01772	赣锋锂业	27,400	2,644,683.07	0.24
19	002223	鱼跃医疗	66,800	2,547,084.00	0.23
20	H06886	HTSC	258,800	2,454,902.27	0.22
21	601012	隆基股份	27,126	2,409,873.84	0.22
22	H00175	吉利汽车	118,000	2,400,634.01	0.22
23	600741	华域汽车	75,318	1,978,603.86	0.18
24	688333	铂力特	10,135	1,894,332.85	0.17
25	600115	中国东航	368,700	1,872,996.00	0.17
26	603650	彤程新材	30,300	1,457,430.00	0.13
27	603688	石英股份	61,300	1,440,550.00	0.13
28	600276	恒瑞医药	20,880	1,419,213.60	0.13
29	300775	三角防务	36,900	1,409,580.00	0.13
30	600570	恒生电子	14,520	1,353,990.00	0.12
31	600576	祥源文化	256,100	1,306,110.00	0.12

32	603063	禾望电气	77,600	1,283,504.00	0.12
33	300207	欣旺达	39,400	1,282,864.00	0.12
34	600406	国电南瑞	49,920	1,160,140.80	0.10

注：对于同时在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601012	隆基股份	24,724,024.00	4.00
2	600036	招商银行	9,980,148.32	1.62
3	H01810	小米集团 -W	7,730,698.85	1.25
4	002352	顺丰控股	6,440,981.20	1.04
5	H01772	赣锋锂业	5,833,688.81	0.94
6	600438	通威股份	5,779,411.00	0.94
7	H00175	吉利汽车	5,717,195.94	0.93
8	600893	航发动力	5,686,438.00	0.92
9	300433	蓝思科技	5,586,753.24	0.90
10	H00700	腾讯控股	5,414,548.09	0.88
11	000768	中航西飞	3,913,465.00	0.63
12	002050	三花智控	3,438,345.00	0.56
13	H09922	九毛九	3,334,016.33	0.54
14	H06886	HTSC	3,309,476.12	0.54
15	603098	森特股份	3,250,370.00	0.53
16	H03690	美团-W	3,189,779.51	0.52
17	H01801	信达生物	3,122,927.71	0.51
18	002311	海大集团	2,866,665.00	0.46
19	002267	陕天然气	2,815,737.00	0.46

20	600115	中国东航	2,677,579.00	0.43
----	--------	------	--------------	------

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601012	隆基股份	33,630,502.94	5.44
2	H01772	赣锋锂业	8,803,250.78	1.43
3	H06886	HTSC	6,586,818.41	1.07
4	H00175	吉利汽车	5,897,791.68	0.95
5	600438	通威股份	5,668,540.19	0.92
6	002311	海大集团	5,396,110.00	0.87
7	000768	中航西飞	5,351,402.39	0.87
8	H01810	小米集团 -W	4,430,867.76	0.72
9	002460	赣锋锂业	4,113,354.20	0.67
10	600036	招商银行	3,963,844.03	0.64
11	603650	彤程新材	3,484,599.00	0.56
12	H09922	九毛九	3,343,746.50	0.54
13	600893	航发动力	3,334,448.76	0.54
14	H01801	信达生物	3,321,006.01	0.54
15	300775	三角防务	2,958,438.00	0.48
16	600115	中国东航	2,489,660.00	0.40
17	000998	隆平高科	2,269,743.00	0.37
18	H00700	腾讯控股	2,161,349.20	0.35
19	600570	恒生电子	2,145,615.00	0.35
20	002223	鱼跃医疗	2,144,766.00	0.35

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	146,985,366.61
卖出股票收入（成交）总额	118,445,575.85

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	66,132,235.80	5.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	501,465,000.00	45.04
	其中：政策性金融债	501,465,000.00	45.04
4	企业债券	264,089,300.00	23.72
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	145,504,500.00	13.07
7	可转债(可交换债)	5,971,857.68	0.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	983,162,893.48	88.31

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	200210	20国开10	1,000,000	96,760,000.00	8.69
2	200205	20国开05	1,000,000	96,670,000.00	8.68
3	190215	19国开15	700,000	69,671,000.00	6.26
4	210201	21国开01	600,000	60,036,000.00	5.39
5	190210	19国开10	500,000	50,500,000.00	4.54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一天内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

国家开发银行： 员工违规：因未依法履行其他职责，分支行高管王庆丰被中国银行保险监督管理委员会海南监管局于2020-04-20依据相关法规给予：公开批评处分决定。
违规行为公告：因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会海南监管局于2020-04-20依据相关法规给予：公开处罚处分决定。 因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会四川监管局于2020-12-23依据相关法规给予：公开处罚处分决定。
因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会北京监管局于2021-01-13依据相关法规给予：公开处罚，责令改正处分决定。 因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会陕西监管局于2021-05-06依据相关法规给予：公开处罚处分决定。 因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会陕西监管局于2021-05-06依据相关法规给予：公开处罚处分决定。 因未依法履行其他职责，公司高管任重远被中国人民银行南

宁中心支行于2021-05-19日依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管冯学佳被中国人民银行南宁中心支行于2021-05-19日依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,中国人民银行南宁中心支行于2021-05-19依据相关法规给予:公开处罚处分决定。银保监罚决字[2020]67号,未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况十六、逾期未整改,屡查屡犯,违规新增业务十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表十八、违规收取小微企业贷款承诺费十九、收取财务顾问费质价不符二十、利用银团贷款承诺费浮利分费二十一、向检查组提供虚假整改说明材料二十二、未如实提供信贷资产转让台账二十三、案件信息迟报、瞒报二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位,罚款4880万元。京汇罚[2020]33号,违规开展外汇交易,处60万元人民币罚款,要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。京汇罚[2020]32号,违反银行交易记录管理规定,处60万元人民币罚款,要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

中国农业发展银行: 因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会广西监管局于2020-07-09依据相关法规给予:公开处罚处分决定。员工违规:因未依法履行其他职责,公司高管张应富被中国银行业监督管理委员会黔南监管分局于2020-09-21依据相关法规给予:公开处罚处分决定。违规行为公告:因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会黔南监管分局于2020-09-21依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会德州监管分局于2020-11-10依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会商丘监管分局于2020-11-23依据相关法规给予:公开处罚处分决定。员工违规:因未依法履行其他职责,公司高管王涛被中国银行保险监督管理委员会周口监管分局于2020-12-15依据相关法规给予:公开批评处分决定。违规行为公告:因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会开封监管分局于2020-12-18依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会内蒙古监管局于2020-12-28依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会晋城监管分局于2021-01-14依据相关法规给予:公开处罚,责令改正处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会阿克苏监管分局于2020-12-10依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会玉溪监管分局于2021-02-09依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管洁红被中国银行保险监督管理委员会内蒙古监管局于2021-02-25日依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管许斌被中国银行保险监督管理委员会内蒙古监管局于2021-02-25日依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会内蒙古监管局于2021-01-15依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他

职责,公司高管单铁刚被中国银行保险监督管理委员会内蒙古监管局于2021-03-12日依据相关法规给予:公开处罚,公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管刘玮璐被中国银行保险监督管理委员会亳州监管分局于2021-03-23日依据相关法规给予:公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管尚亚东被中国银行保险监督管理委员会亳州监管分局于2021-03-23日依据相关法规给予:公开处罚,公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会普洱监管分局于2021-03-18依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会亳州监管分局于2021-03-23依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会黄冈监管分局于2021-03-29依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管马晓磊被中国银行保险监督管理委员会内蒙古监管局于2021-04-12日依据相关法规给予:公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会舟山监管分局于2021-04-15依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管张静被中国银行保险监督管理委员会宿州监管分局于2021-04-23日依据相关法规给予:公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会宿州监管分局于2021-04-15依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管永周才仁被中国银行保险监督管理委员会玉树监管分局于2021-04-25日依据相关法规给予:公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会玉树监管分局于2021-04-25依据相关法规给予:公开处罚,责令改正处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会曲靖监管分局于2021-04-25依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管严松春被中国银行保险监督管理委员会浙江监管局于2021-06-15日依据相关法规给予:公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管中国农业发展银行浙江省分行被中国银行保险监督管理委员会浙江监管局于20210615日依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管徐申林被中国银行保险监督管理委员会浙江监管局于2021-06-15日依据相关法规给予:公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管樊荣被中国银行保险监督管理委员会浙江监管局于2021-06-15日依据相关法规给予:公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会浙江监管局于2021-06-15依据相关法规给予:公开处罚处分决定。因未依法履行其他职责,公司高管李天元被中国银行保险监督管理委员会湖州监管分局于2021-06-29日依据相关法规给予:公开批评处分决定。因未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会湖州监管分局于2021-06-29依据相关法规给予:公开处罚处分决定。

7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	28,062.65
4	应收利息	9,907,487.15
5	应收申购款	367,381.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,302,931.71

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额	持有份额	占总份 额比例

				比例		
朱雀安鑫回报A	1,333	665,099.81	756,995,845.20	85.38%	129,582,202.91	14.62%
朱雀安鑫回报C	1,090	86,988.14	18,792,385.91	19.82%	76,024,683.25	80.18%
合计	2,423	405,033.07	775,788,231.11	79.00%	205,606,886.16	21.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	朱雀安鑫回报A	10,050,796.07	1.13%
	朱雀安鑫回报C	64,451.45	0.07%
	合计	10,115,247.52	1.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	朱雀安鑫回报A	0
	朱雀安鑫回报C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	朱雀安鑫回报A	50~100
	朱雀安鑫回报C	0
	合计	50~100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份	发起份额总数	发起份额占基金总份	发起份

		额比例		额比例	额 承 诺 持 有 期 限
基金管理人固有资金	9,000,000.00	0.92%	9,000,000.00	0.92%	3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	1,000,000.00	0.10%	1,000,000.00	0.10%	3 年
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,000.00	1.02%	10,000,000.00	1.02%	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	朱雀安鑫回报A	朱雀安鑫回报C
基金合同生效日(2020年03月18日)基金份额总额	433,369,111.83	191,280,015.10
本报告期期初基金份额总额	464,449,887.46	95,815,319.35
本报告期基金总申购份额	565,813,852.78	61,909,875.34
减：本报告期基金总赎回份额	143,685,692.13	62,908,125.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	886,578,048.11	94,817,069.16

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人

本报告期基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	244,450,030.46	100.00%	250,352.91	100.00%	-

基金管理人负责选择证券经纪机构，使用其专用的交易单元作为本基金的交易单元。基金管理人根据内部控制、合规状况、诚信状况、人员储备、业务隔离措施、软硬件设施、专业能力、程序状况等综合评定选择证券经纪机构。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	427,472,143.62	100.00%	3,573,350,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	朱雀安鑫回报债券发起式证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
2	朱雀安鑫回报债券发起式证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-03
3	朱雀安鑫回报债券发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-03
4	朱雀安鑫回报债券发起式证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
5	朱雀安鑫回报债券发起式证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

别		20%的时间区间					
机构	1	20210201-20210630	99,999,000.00	178,363,506.64	0.00	278,362,506.64	28.36%
产品特有风险							
<p>本基金报告期内存在单一机构投资者持有的基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，如遇巨额赎回的情形可能会产生因基金仓位调整困难无法及时变现导致的流动性风险。</p> <p>当基金出现巨额赎回时，本着保护广大投资者的原则，基金管理人有权依照本基金招募说明书的约定，根据当时的资产组合状况决定选择全部赎回、部分延期赎回、延期办理赎回申请或暂停赎回。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务获批、营业执照
- 6、基金托管人业务获批、营业执照
- 7、关于申请募集注册朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金的法律意见书
- 8、报告期内获批的各项公告

12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人的办公场所

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.rosefinchfund.com）查阅。支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人朱雀基金管理有限公司。本公司客户服务电话：400-921-7211（全国免长途费）。

朱雀基金管理有限公司
二〇二一年八月二十六日

