
朱雀企业优胜股票型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022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:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年04月01日起至2022年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 朱雀企业优胜 |
| 基金主代码 | 008294 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020年05月22日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,004,361,575.10份 |
| 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>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，合理调整股票资产、债券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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理</p> |

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。企业在市场竞争中优胜劣汰，大浪淘沙。本基金将致力于寻找激烈竞争后优胜的企业，通过投资具有可持续竞争优势的上市公司或者未来具有广阔成长空间的公司来获得超越业绩比较基准的投资回报。

（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

比较和增长性分析,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)、公司自由现金流贴现模型(FCFF模型)等。

(4) 港股通标的股票投资策略

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。

3、债券投资策略

本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响,进行合理的利率预期,判断市场的基本走势,制定久期控制下的资产类属配置策略。在固定收益资产投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

4、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。

5、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| | <p>6、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> <p>7、存托凭证投资策略</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> | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*10%+中债综合指数收益率*20% | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承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> | |
| 基金管理人 | 朱雀基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 朱雀企业优胜A | 朱雀企业优胜C |
| 下属分级基金的交易代码 | 008294 | 008295 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 826,756,976.52份 | 177,604,598.58份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2022年04月01日 - 2022年06月30日) | |
|------------|--------------------------------|---------------|
| | 朱雀企业优胜A | 朱雀企业优胜C |
| 1. 本期已实现收益 | -3,299,666.93 | -1,974,199.09 |

| | | |
|-----------------|------------------|----------------|
| 2. 本期利润 | 128,705,831.80 | 27,895,608.63 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1481 | 0.1432 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,276,506,416.05 | 269,898,467.98 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.5440 | 1.5197 |

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、所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，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

朱雀企业优胜A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 11.05% | 2.01% | 5.05% | 1.12% | 6.00% | 0.89% |
| 过去六个月 | -13.14% | 1.87% | -6.73% | 1.17% | -6.41% | 0.70% |
| 过去一年 | -7.79% | 1.51% | -11.82% | 1.00% | 4.03% | 0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | 54.40% | 1.47% | 10.21% | 1.00% | 44.19% | 0.47% |

朱雀企业优胜C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 10.82% | 2.00% | 5.05% | 1.12% | 5.77% | 0.88% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 三个月 | | | | | | |
| 过去六个月 | -13.48% | 1.87% | -6.73% | 1.17% | -6.75% | 0.70% |
| 过去一年 | -8.52% | 1.51% | -11.82% | 1.00% | 3.30% | 0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | 51.97% | 1.47% | 10.21% | 1.00% | 41.76% | 0.47% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



朱雀企业优胜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



注：

- 1、本基金建仓期为本基金合同生效之日（2020年5月22日）起6个月。
- 2、本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*10%+中债综合指数收益率*20%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 梁跃军 | 公司总经理/基金经理 | 2020-06-03 | - | 15 | 梁跃军，经济学硕士。先后任职于招商银行股份有限公司北京分行、西南证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、上海朱雀投资发展中心（有限合伙）、朱雀股权投资管理有限公司。现任公司总经 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 理，担任朱雀企业优胜股票型证券投资基金、朱雀产业臻选混合型证券投资基金、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、朱雀产业智选混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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、证券从业年限的计算标准及含义遵从从业人员的相关规定。

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，在防范投资风险的前提下，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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度市场表现先抑后扬，因受疫情冲击影响，主要指数4月快速下跌并于月末企稳，5-6月则快速回补了3月份以来的跌幅，我们产品在6月适当调低了总体仓位，持仓结构没有大的变化。

A股市场在4月末企稳后，5-6月经历了一轮显著的上涨，6月以来的涨幅尤其显著。我们认为这轮上涨主要是对前期俄乌冲突和国内疫情两大因素造成市场下跌的修复。在完成修复之后，我们判断市场将进入震荡整理阶段并步入原有的运行轨道。

首先，市场大的运行逻辑并没有改变。我们一直以来的观点是A股市场走慢牛，其宏观背景是中国经济从高速增长阶段进入高质量发展阶段，高质量发展在A股市场表现为结构性机会，指数上走慢牛。俄乌冲突和国内疫情，对产业链造成较大冲击，制造业首当其冲，新能源相关行业公司出现了较大幅度的调整，带动整个市场在3-4月份出现了快速下跌。在疫情受控之后，我们看到增长最确定的还是在新能源相关领域，相关公司因疫情只是延后了订单交付，需求旺盛的基本面没有变化，股价表现为迅速修复跌幅。

其次，经济增长弹性的变化不支持所谓的板块轮动。经历过08年金融危机和2014年到2015年市场变化的投资者对A股市场的板块轮动都比较熟悉，伴随一轮经济周期起伏，投资板块率先发力并拉动上游资源，接下来逐步过渡到中游，最后到下游终端消费品，板块切换节奏很明显。这里面有个前提就是中国经济处于高速增长阶段且房地产投资对经济持续拉动作用显著，当时中国经济走出周期低谷并重上增长轨道房地产投资都起到了关键作用。回到当下，我们看到为促进经济增长，中央和地方已出台一系列房地产支持政策，但受各种因素影响，房地产市场很难像过去那样表现，使得经济增长弹性发生很大变化，从而间接影响到消费。总体偏弱的宏观总需求不支持板块的轮动表现，更多要看结构与个股。

最后，碳中和将是中国率先走出全球滞胀格局的重要抓手。

全球滞胀压力加大的背景下，能源转型无疑是缓解滞胀的重大抓手。能源结构转型既能有效缓和全球能源供给约束的不利影响、降低我国传统能源依赖，也能够带来中国经济增长的新动能，有助于中国率先走出全球滞胀周期。

发展新能源产业链抢占全球高端制造的先发优势，是我国制造业发展新的增长点。双碳强调先立后破，通过政策支持、市场化推进在国内扩展需求，同时反哺技术进步，使得中国产能和技术在全球新能源产业链也抢占主导地位。国内“双碳”相关技术已经较为成熟，光伏、风电等新能源经过多轮技术迭代，迎来平价上网时代。国内新能源车渗透率已经突破25%，行业迈入快速增长期。

传统能源低碳转型有助降低对传统能源的依赖，减小国内通胀对能源价格波动的敏感度。中国有“富煤贫油少气”的资源结构特点，在全球化石能源大幅涨价的背景下容易面临输入性通胀风险。尽快实现传统产能的低碳升级将有利于我国摆脱碳排放限制造成的经济增长约束，同时也可以稳固国家能源安全。

碳中和既是投资（稳增长），也是增长（利润率驱动的新增需求），是科技创新（中国技术引领），也是国际合作（中国产业链优势）。从能源革命开始，到消费革命，到整个制造业转型，碳中和也会催化整个金融体系的改革和变化（政府地产银行债务驱动

—新兴产业股权驱动)。“高质量发展”在未来经济发展中处于核心地位，将帮助中国在全球竞争中取得领先地位。

结构方面，我们将继续坚持在高质量发展的方向上以双碳领域为抓手深入布局，双碳领域无论在短期还是中长期而言都有确定的需求增长，实现碳达峰和碳中和目标是突破滞胀的抓手。我们将充分挖掘把握其中的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末朱雀企业优胜A基金份额净值为1.5440元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.05%，同期业绩比较基准收益率为5.05%；截至报告期末朱雀企业优胜C基金份额净值为1.5197元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.82%，同期业绩比较基准收益率为5.05%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 1,349,569,899.38 | 86.94 |
| | 其中：股票 | 1,349,569,899.38 | 86.94 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 201,717,182.68 | 12.99 |
| 8 | 其他资产 | 1,053,769.73 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 1,552,340,851.79 | 100.00 |

注：权益投资中港股通股票公允价值为118,729,200.45元，占基金总资产比例7.65%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 1,001,319,538.32 | 64.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 75,255,796.00 | 4.87 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 69,011,409.02 | 4.46 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 61,740,529.04 | 3.99 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 18,195,986.55 | 1.18 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,317,440.00 | 0.34 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,230,840,698.93 | 79.59 |

5.2.2 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(%) |
|----------|---------------|--------------|
| 非日常生活消费品 | 46,439,126.01 | 3.00 |
| 工业 | 52,983,920.74 | 3.43 |

| | | |
|------|----------------|------|
| 通讯业务 | 19,306,153.70 | 1.25 |
| 合计 | 118,729,200.45 | 7.68 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 601012 | 隆基绿能 | 2,253,955 | 150,181,021.65 | 9.71 |
| 2 | 002311 | 海大集团 | 2,230,940 | 133,878,709.40 | 8.66 |
| 3 | 000792 | 盐湖股份 | 3,850,700 | 115,366,972.00 | 7.46 |
| 4 | 603063 | 禾望电气 | 2,010,100 | 77,288,345.00 | 5.00 |
| 5 | 603098 | 森特股份 | 2,098,600 | 75,255,796.00 | 4.87 |
| 6 | 002352 | 顺丰控股 | 1,236,542 | 69,011,409.02 | 4.46 |
| 7 | 688333 | 铂力特 | 311,833 | 56,981,244.09 | 3.68 |
| 8 | 300124 | 汇川技术 | 860,450 | 56,677,841.50 | 3.67 |
| 9 | 601877 | 正泰电器 | 1,485,400 | 53,147,612.00 | 3.44 |
| 10 | 002028 | 思源电气 | 1,149,400 | 40,987,604.00 | 2.65 |

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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

禾望电气：2021年9月29日，就公司股东减持股份事项明确监管要求，受到上海证券交易所监管关注(上证公函[2021]2776号)。

盐湖股份：2021年9月17日，因推动商品价格过快上涨，收到市场监管总局整改通知，责令立即改正并罚款160万元(市监处罚[2021]71号)。2021年10月11日，因未及时履行相关审议程序及披露义务，收到深圳证券交易所的监管函(公司部监管函(2021)第156号)。2021年10月27日，因未及时履行相关临时信息披露义务，收到深圳证券交易所的监管函(公司部监管函(2021)第163号)。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司正常经营不会产生重大、实质性影响，对上述公司正常投资不会产生实质性影响，本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序均符合相关法律法规及基金合同的要求。本基金管理人将持续对上述公司进行跟踪研究。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 217,332.00 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 836,437.73 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,053,769.73 |

5.11.4 报告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债。

5.11.5 报告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情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 朱雀企业优胜A | 朱雀企业优胜C |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 889,713,036.47 | 201,126,994.46 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 9,001,550.60 | 42,960,042.38 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 71,957,610.55 | 66,482,438.26 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 826,756,976.52 | 177,604,598.58 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | 朱雀企业优胜A | 朱雀企业优胜C |
|--------------------------|---------------|---------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 15,611,404.23 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 15,611,404.23 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 1.55 | - |

注：本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有本基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予朱雀企业优胜股票型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《朱雀企业优胜股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《朱雀企业优胜股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《朱雀企业优胜股票型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企业优胜股票型证券投资基金的法律意见书
- 8、报告期内获批的各项公告

9.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人的办公场所

9.3 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

2022年07月21日