

---

# 朱雀企业优选股票型证券投资基金

## 2021年第2季度报告

### 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:广发证券股份有限公司

报告送出日期:2021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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月16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2021年04月01日起至2021年06月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	朱雀企业优选
基金主代码	010141
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年09月23日
报告期末基金份额总额	4,985,846,995.10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>本基金为股票型基金，将以权益性资产为主要配置。在此基础上，本基金通过对宏观经济政策及证券市场整体走势进行前瞻性研究，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，在给定区间内合理调整股票资产、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念，在宏观策略研究基础上，把握结构性调整机会，</p>

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，并参照核心股票库品种构建组合。

#### （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

本基金主要寻找产业链中最具性价比的环节，优选该环节中具有竞争力的上市企业。具体而言，主要将从四个方面来优选：一是行业特征，优选行业天花板较高、处于景气上升阶段的行业中的企业进行投资；二是商业模式，优选盈利具有可持续性，经营具有高壁垒性的上市企业；三是治理结构，优选治理结构中管理人具有积极向上和规范敬业的管理态度、并具有企业家精神的上市企业；四是财务评价，优选资产负债表健康、财务稳健的上市企业。

#### （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）、公司自由现金流贴现模型（FCFF模型）等。

### 3、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。

### 4、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。

### 5、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。

### 6、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。

### 7、资产支持证券投资策略

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

	<p>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>8、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	<p>中证800指数收益率*70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*15%+中债综合全价(总值)指数收益率*15%</p>	
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金可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>	
基金管理人	朱雀基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	朱雀企业优选A	朱雀企业优选C
下属分级基金的交易代码	010141	010142
报告期末下属分级基金的份额总额	4,219,579,864.49份	766,267,130.61份
下属分级基金的风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金可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>本基金为股票型基金，其风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金可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>

### § 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(2021年04月01日 - 2021年06月30日)	
	朱雀企业优选A	朱雀企业优选C

1. 本期已实现收益	-5,879,173.95	-2,920,773.90
2. 本期利润	520,538,046.78	94,701,725.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1173	0.1138
4. 期末基金资产净值	5,273,638,180.21	951,844,005.47
5. 期末基金份额净值	1.2498	1.2422

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

朱雀企业优选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	10.55%	1.01%	3.47%	0.72%	7.08%	0.29%
过去六个月	4.37%	1.47%	2.29%	0.99%	2.08%	0.48%
自基金合同生效起至今	24.98%	1.32%	10.92%	0.93%	14.06%	0.39%

朱雀企业优选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
过去三个	10.33%	1.01%	3.47%	0.72%	6.86%	0.29%

月						
过去六个月	3.96%	1.47%	2.29%	0.99%	1.67%	0.48%
自基金合同生效起至今	24.22%	1.32%	10.92%	0.93%	13.30%	0.39%

### 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

朱雀企业优选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09月23日-2021年06月30日)



朱雀企业优选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09月23日-2021年06月30日)



注：

- 1、本基金建仓期为本基金合同生效之日（2020年9月23日）起6个月。
- 2、本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率\*70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*15%+中债综合全价(总值)指数收益率\*15%。

## § 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	2020-09-23	-	14.5	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的基金经理。
黄昊	公募投资部基金经理	2020-10-29	-	5.5	黄昊，产业经济学硕士。先后任职于上海壹德资产管理有限公司、中国投资咨询有限责任公司、朱雀股权投资管理有限公司和上海朱雀资产管理有限公司。现任公司公募投资部基金经理，担任朱雀企业优选股票型证券投资基金、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 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

回顾二季度的市场表现，经历了2、3月份的急跌之后总体企稳反弹，在5月份出现了一轮较强的上涨，6月份指数走势震荡。此外，二季度市场分化的特征明显，其中创业板指数大幅领先于沪深300，反映出投资者对于不同阶段产业复苏的认识差异。

产品操作层面，我们在4月份基于产业未来景气变化做了持仓结构调整，5、6月份以持有为主，从结果看这个调整是比较有效的，产品净值创出反弹以来的高点。

对于未来市场的看法，我们维持A股市场表现为慢牛的观点。

向后展望，我们判断宏观经济景气度经历二季度高点后，下半年基本回到常规状态。中国经济从高速增长往中速增长阶段换挡基本结束，供求更为平衡。从中长期的结构性视角观察，全球通胀的中枢可能会有一定抬升。我国的货币政策经历了四年的宽松周期后，“跨周期”思路下央行货币政策从去年5月份就开始做出前瞻性调整，在其它主要经济体还在继续放水时，我们已经在做收缩，在经济过热前提前做调整。今年财政收入明显恢复，在财政政策蓄势待发、货币空间有限的情况下，广义财政可能会在未来承担更多稳增长的职能，债务周期也可能会在今年年底再度进入扩张周期，以保证经济增速保持在合理区间内。

关于通胀，央行货币执行报告认为全球大宗商品价格上涨可能阶段性推升我国PPI，但输入性通胀的风险总体可控。我国在去年应对疫情时坚持实施正常的货币政策，没有搞大水漫灌，经济发展稳中向好，保持了总供求基本平衡，不存在长期通胀或通缩的基础。鉴于市场一直担心央行收紧流动性来应对通胀，而央行清晰表达了不担心通胀的扩散和持续性，因此市场的担忧逐步消除。

此外，国常会部署做好大宗商品保供稳价工作，保持经济平稳运行。商品受到政策强力打压后出现明显回落，未来应会逐步回归基本面走势。从国内情况来看，5月份PPI已见顶，未来同比数据应该会下降。另一个指标CPI主要的影响因素猪价处于下降趋势，所以整体国内通胀压力不大。关于海外通胀情况，美国10年期国债收益率最近在缓慢回落，意味着美国整体经济复苏较弱，经济增长、解决就业是美国当前的主要关注点。

总体来看，我们认为宏观调控部门跨周期调节将保持经济平稳运行，未来我们会面临比较稳定的宏观环境。在此背景下，我们投资策略将更加注重自下而上根据产业景气变化来指导投资实践，在景气度最高的产业环节优选核心标的。

具体来讲，光伏领域我们看好上游材料环节和下游光伏新的应用环节。新能源汽车板块在高景气度下二季度表现比较充分，我们预计未来销量增速将逐步下行，好的行业也需要一个相对合理的价格，所以我们在投资上会有一些取舍。在下半年宏观经济整体走弱的情况下，大类行业里军工基本面最为确定，我们会持续关注。对电子制造我们依然看好，主要公司业绩增长确定性强而估值相对合理。考虑未来成长的确定性，我们增加了生物医药的投资品种和持仓。金融行业的持仓我们做了一定调整以便更好适应未来宏观经济环境。我们坚定看好农业领域竞争格局清晰、增长确定的公司。此外，我们在汽车智能化、商业航天、半导体领域、品牌消费等方面也做了相应品种的准备。

总结来看，我们认为市场将回到慢牛轨道，没有大的宏观风险，在相对稳定的环境下，未来一批拥有全球竞争力的中国企业和中国企业家高度不可限量，对投资而言，关键是提前发现和支持产业发展中的赢家，我们将集中精力自下而上挖掘结构性机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末朱雀企业优选A基金份额净值为1.2498元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.55%，同期业绩比较基准收益率为3.47%；截至报告期末朱雀企业优选C基金份额净值为1.2422元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.33%，同期业绩比较基准收益率为3.47%。

#### 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	5,405,806,491.20	86.02
	其中：股票	5,405,806,491.20	86.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	368,349,859.70	5.86
	其中：债券	368,349,859.70	5.86
	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	456,679,135.83	7.27
8	其他资产	53,218,483.85	0.85
9	合计	6,284,053,970.58	100.00

注：权益投资中港股通股票公允价值为1,252,835,884.12元，占基金总资产比例19.94%。

## 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	2,558,919,009.64	41.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	93,394,221.87	1.50
E	建筑业	259,552,766.86	4.17
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	373,136,767.54	5.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,227,668.92	3.59
J	金融业	516,752,967.93	8.30
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	92,570,519.52	1.49
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	35,416,684.80	0.57
S	综合	-	-

合计	4,152,970,607.08	66.71
----	------------------	-------

### 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(%)
基础材料	127,253,655.55	2.04
非日常生活消费品	241,778,117.98	3.88
日常消费品	106,092,696.24	1.70
金融	175,371,843.46	2.82
医疗保健	139,048,909.60	2.23
信息技术	201,031,692.91	3.23
电信服务	262,258,968.38	4.21
合计	1,252,835,884.12	20.12

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	600036	招商银行	9,535,947	516,752,967.93	8.30
2	600438	通威股份	10,297,930	445,591,431.10	7.16
3	002311	海大集团	5,173,187	422,132,059.20	6.78
4	300433	蓝思科技	10,043,963	294,198,769.83	4.73
5	600893	航发动力	5,332,332	283,626,739.08	4.56
6	H00700	腾讯控股	539,700	262,258,968.38	4.21
7	002460	赣锋锂业	1,054,143	127,646,175.87	2.05
7	H01772	赣锋锂业	1,318,400	127,253,655.55	2.04

8	603098	森特股份	6,369,359	247,768,065. 10	3.98
9	002352	顺丰控股	3,609,605	244,370,258. 50	3.93
10	H03690	美团-W	906,900	241,778,117. 98	3.88

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	184,945,000.00	2.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	183,404,859.70	2.95
	其中：政策性金融债	183,404,859.70	2.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	368,349,859.70	5.92

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019640	20国债10	1,849,450	184,945,000.00	2.97
2	108604	国开1805	1,829,110	183,404,859.70	2.95

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 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年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

美团-W：因违反《网络餐饮服务食品安全监督管理办法》第八条第一款及《中华人民共和国食品安全法》第一百三十一条第一款规定，北京市西城区市场监督管理局于2021-4-9依据相关法规给予：罚款70000元，没收违法所得164.4元处分决定。

因构成违法实施的经营者集中，国家市场监督管理总局于2021-7-6依据相关法规给予：罚款50万元处分决定。

腾讯控股：因价格垄断，国家市场监督管理总局于2021-3-12依据相关法规给予：罚款50万处分决定。

因未依法履行职责，国家互联网信息办公室于2021-3-12依据相关法规给予：诫勉谈话，下达整改通知处分决定。

因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-4-30依据相关法规给予：罚款50万处分决定。

因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-4-30依据相关法规给予：罚款50万处分决定。

因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-7-7依据相关法规给予：罚款50万处分决定。

因涉嫌价格垄断，国家市场监管总局于2021-7-7依据相关法规给予：罚款50万处分决定。

因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-7-7依据相关法规给予：罚款50万处分决定。

因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-7-7依据相关法规给予：罚款50万处分决定。

因违规经营，工业和信息化部于2021-7-8依据相关法规给予：责令改正处分决定。

招商银行：因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局于2021-6-8依据相关法规给予：公开处罚处分决定。

因其他违法，中国银行保险监督管理委员会于2021-5-17依据相关法规给予：罚款7170万元处分决定。

因违反规定办理结汇、售汇行为，国家外汇管理局深圳市分局于2020-11-27依据相关法规给予：责令改正、罚款人民币55万元、没收违法所得128.82万元处分决定。

因违反外汇市场交易管理行为，国家外汇管理局深圳市分局于2020-9-29依据相关法规给予：责令改正、罚款人民币120万元、对直接负责主管和其他直接责任人员给予处分决定。

### 5.11.2 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。

### 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	41,821,458.12
3	应收股利	1,279,351.02
4	应收利息	9,388,341.44
5	应收申购款	729,333.27
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	53,218,483.85

### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300433	蓝思科技	55,452,419.00	0.89	非公开发行限售

### 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

	朱雀企业优选A	朱雀企业优选C
报告期期初基金份额总额	4,575,953,393.89	866,731,896.63
报告期期间基金总申购份额	51,153,320.90	27,677,305.88
减：报告期期间基金总赎回份额	407,526,850.30	128,142,071.90
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	4,219,579,864.49	766,267,130.61

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

	朱雀企业优选A	朱雀企业优选C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	-
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	5,000,000.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.12	-

## 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

注：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选股票型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《朱雀企业优选股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《朱雀企业优选股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《朱雀企业优选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选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](http://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

2021年07月21日