

朱雀碳中和三年持有期混合型发起式证券投资基金

2026年第1季度报告

2026年03月31日

基金管理人:朱雀基金管理有限公司

基金托管人:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2026年04月22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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年4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2026年01月01日起至2026年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	朱雀碳中和三年持有
基金主代码	015729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年09月07日
报告期末基金份额总额	209,035,854.11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、主题股票投资策略</p> <p>碳中和是指企业、团体或个人在一定时间内直接或间接产生的二氧化碳排放总量，通过二氧化碳去除手段，达到“净零排放”目的。</p> <p>2020年，国家提出二氧化碳排放力争于2030年前达到峰值，努力争取2060年前实现碳中和。2021年10月26日，国务院印发《2030年前碳达峰行动方案》，提出了“碳达峰十大行动”，包括能源绿色低碳转型行动、节能降碳增效行动、工业领域碳达峰行动、城乡建设碳达峰行动、交通运输绿色低碳行动、循环经济助力降碳行动、绿色低碳科技创新行动、碳汇能力巩固提</p>

	<p>升行动、绿色低碳全民行动、各地区梯次有序碳达峰行动。</p> <p>本基金投资标的将围绕碳中和目标下减碳路径所涉及的相关产业链和行业。从碳排放源出发，中国碳中和的减碳路径主要是电力行业脱碳化、工业行业节能化、交运行业电力化智能化、建筑行业绿色化，以及其他支持碳中和目标的公共事业、TMT、绿色金融行业。具体的行业、投资方向如下：</p> <p>1) 电力行业：对应新能源产业链。主要包括以光伏与风电为代表的新能源及其相关的产业链制造环节、终端电站运营环节、以及相关制造设备环节；核电、水电、生物质、天然气、氢能、分布式发电、储能、新型电力系统建设（电力电子设备、电网设备）相关的公司。</p> <p>2) 工业行业：对应节能减排产业链。指在工业生产环节中，通过技术升级与工艺改造减少碳排放量，涉及钢铁、化工、和工业服务行业。其中：钢铁行业主要关注节能降碳潜力技术，包括特种钢材、电炉炼钢和氢能炼钢。</p> <p>3) 交运行业：对应新能源车产业链。包括新能源车（动力电池、上、中游核心资源与材料、锂电生产装备、汽车主机厂商）、绿色智慧交通（充电桩、加注（气）站、加氢站、多式联运、智慧民航、汽车芯片、汽车电子、算法、汽车共享运营）相关公司。</p> <p>4) 建筑行业：对应绿色建筑产业链。包括低碳环保建材、装配式建筑、光伏发电与建筑一体化应用。</p> <p>5) 公用事业行业：对应环保产业链。主要投资碳捕获、利用与封存技术、生态修复。</p> <p>2、非主题股票投资策略</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，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。</p> <p>(1) 自上而下的行业遴选</p>
--	--

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、行业的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。

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

	<p>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>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股票投资策略执行。</p>
业绩比较基准	中证内地低碳经济主题指数*50%+恒生指数收益率*20%+沪深300收益率*10%+中债综合全价指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型发起式基金，其风险和预期收益水平理论上高于债券型基金及货币市场基金，而低于股票型基金。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。
基金管理人	朱雀基金管理有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司

§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（2026年01月01日 - 2026年03月31日）
1.本期已实现收益	26,409,843.64
2.本期利润	12,059,931.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0509
4.期末基金资产净值	208,273,696.82
5.期末基金份额净值	0.9964

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。

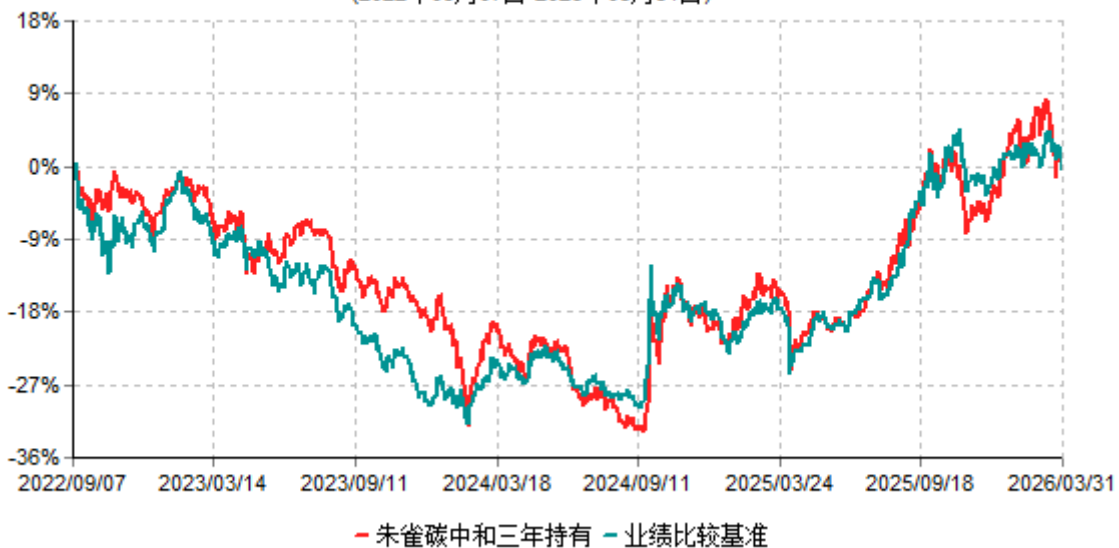
3.2 基金净值表现

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

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	3.45%	1.42%	1.27%	0.89%	2.18%	0.53%
过去六个月	-0.90%	1.35%	-0.68%	1.02%	-0.22%	0.33%
过去一年	20.14%	1.28%	23.25%	1.03%	-3.11%	0.25%
过去三年	6.91%	1.20%	8.69%	1.03%	-1.78%	0.17%
自基金合同生效起至今	-0.36%	1.15%	-0.37%	1.03%	0.01%	0.12%

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

朱雀碳中和三年持有累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年09月07日-2026年03月31日)



注：

- 1、本基金建仓期为本基金合同生效之日（2022年9月7日）起6个月。
- 2、本基金的业绩比较基准：中证内地低碳经济主题指数*50%+恒生指数收益率*20%+沪深300收益率*10%+中债综合全价指数收益率*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	2022-09-07	-	19.5	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，担任朱雀产业臻选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、朱雀碳中和三年持有期混合型发起式证券投资基金、朱雀产业精选混合型证券投资基金的基金经理。
杨欣达	公募投资部基金经理	2023-09-07	-	7.5	杨欣达，金融学硕士。曾任职于中信建投证券股份有限公司。现任公司公募投资部基金经理，担任朱雀碳中和三年持有期混合型发起式证券投资基金的基金经理。

注：

- 1、“任职日期”和“离任日期”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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、基金合同的约定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，力争为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，无损害基金份额持有人利益的行为，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

2026年一季度，市场经历1、2月份的上涨后，3月份出现调整。中东危机爆发之后，市场从交易降息预期、流动性宽松下的利好成长板块，到担心油价上涨引发滞涨利空成长板块，资金向能源以及防御板块倾斜。成交额从1月初的2万亿最高到1月中旬达到4万亿，随后回落至3万亿附近，进入3月交易量下降至2万亿附近。

近期市场受到中东局势影响，成长板块回调明显。市场在冲突加剧、以及特朗普TACO等事件催化下反复摇摆，对战争的走势以及何时以何种方式结束，恐怕没有人能够预测清楚，核心还是想向各位投资人汇报一下我们的应对的想法。

第一，在仓位上进行一定控制，当市场对事态解决相对乐观的时候对仓位进行下降。

第二，在个股选择上进行取舍。如果将投资比作赛马，那么上等马是好行业、好公司同时出现好价格；中等马是好公司、行业短期逆风、但是有好价格；下等马则是差公司或差行业，当然出现这种情形下也不会有好价格。

对于好公司的定义，我觉得是公司治理优秀、重视股东回报、能够引领行业或者至少做到顺应行业发展。在市场经历一年半的上涨过后，恐怕目前上等马越来越难找，好行业、好公司的估值也体现较为充分，投资他更多是认可其远大前程未来能够兑现。在中东冲突发生前，美国在今明年处于降息周期中，因此对于上等马的估值接受度相对较高，包括但不限于AI产业链、以及AI相关的电力设备、商业航天等环节。由于战争的出现，美国的降息预期不确定性也在加大，因此我们对只看空间、不看短期估值的公司进行了一定减仓。另一方面，我们觉得中等马的投资性价比开始凸显，在一场赛马比赛中，大家往往关注度停留在跑在前面的上等马身上，但当上等马的身价出现千金只能买到马

骨的情况下，伴随着市场的预期回报率下降以及对确定性的要求提升，不妨多关注一下中等马。不同人眼中有不同的中等马，碳中和领域，我觉得中等马包括但不限于以下几个领域：

1) 储能锂电：伴随着新能源装机渗透率提升、AI数据中心的发展、以及能源安全的重要性提升，储能是全球共同的产业趋势。从估值角度，龙头公司估值今年20倍左右PE，伴随未来三年20-30%的行业增长，虽然短期板块受到战争的影响，排产和股价均有上涨，我们会从长期角度结合公司定价思考投资机会；

2) 光伏：由于今年全球新增光伏装机预计出现下滑，同时供给侧进展暂缓，叠加短期出口退税取消后排产走弱，行业盈利和股价均有所承压。但长期看，经历今年的低点后，全球光伏重回增长是大概率事件，能源清洁化、能源安全等是不可逆的产业趋势。供给端来看，企业通过自发收购、兼并等形势淘汰落后产能，行业出清将更加彻底、也更加良性，只是时间节奏较难准确预判，我们积极寻找优质公司，逐步加大关注；

3) 新能源车：由于购置税从全额免征到减半征收、补贴由定额补贴变为比例补贴、以及行业竞争加剧等因素，导致新能源车股价调整幅度较大。但长期来看，电动化、智能化的渗透率将逐步提高，同时车企在具身智能领域也在积极布局，从估值角度，龙头车企估值已回到1倍PS附近，因此从长期角度我们会加大关注力度；

4) 新能源运营商：由于新能源入市比例增加导致电价承压、以及限电率的抬升，导致绿电运营商盈利变差，2025年四季度已经出现部分龙头企业亏损的情况。从行业普遍情况来看，资本开支有所减弱，资本开支中对于光伏的开发进一步收缩。我们认为从十五五的碳达峰的关键阶段，或更有可能理顺收益机制、给予企业合理的回报率。这类资产目前普遍破净，主要反应股东回报率的下降（电价承压）、以及现金流的承压（补贴回款），我们认为这两项因素都有可能出现积极转变。

综上，我们认为以上几个领域是可能输时间、但不输空间的领域，其他领域我们也会积极思考，也欢迎投资者与我们探讨、进行补充。老骥伏枥，志在千里，中等马虽然不是最耀眼的存在，但是长跑的好选手。我们会在当今不确定的市场环境中，寻找这类优质的公司，在把握好建仓节奏、以及控制回撤的前提下，陪伴这些中等马一起奔跑！

我们会围绕能源+科技领域布局，密切跟踪政策和产业发展进程，寻找其中确定性高、估值合理、具备核心竞争力的优质公司进行布局，以获取绝对收益为目标，争取为投资者创造可持续的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末朱雀碳中和三年持有基金份额净值为0.9964元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.45%，同期业绩比较基准收益率为1.27%。

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	184,361,443.96	87.93
	其中：股票	184,361,443.96	87.93
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	25,262,114.56	12.05
8	其他资产	34,311.35	0.02
9	合计	209,657,869.87	100.00

注：权益投资中港股通股票公允价值为46,437,510.30元，占基金资产净值比例22.30%。

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	6,245,646.00	3.00
C	制造业	126,928,039.60	60.94
D	电力、热力、燃气及水 生产和供应业	171,213.00	0.08
E	建筑业	767,719.00	0.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政 业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,586,924.06	1.24
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	1,224,392.00	0.59
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	137,923,933.66	66.22

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 (%)
原材料	8,350,499.63	4.01
非日常生活消费品	11,471,763.20	5.51
日常消费品	97,124.50	0.05
能源	289,695.90	0.14
医疗保健	2,131,370.66	1.02
工业	17,800.27	0.01
信息技术	13,611,521.88	6.54
通讯业务	6,709,360.46	3.22
公用事业	3,758,373.80	1.80
合计	46,437,510.30	22.30

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	002028	思源电气	74,300	15,008,600.00	7.21
2	002001	新和成	426,900	14,749,395.00	7.08
3	601126	四方股份	274,600	11,829,768.00	5.68
4	600183	生益科技	167,900	9,095,143.00	4.37
5	002938	鹏鼎控股	168,700	8,801,079.00	4.23
6	H01772	赣锋锂业	130,000	8,350,499.63	4.01
7	H00981	中芯国际	184,000	8,236,863.96	3.95
8	603606	东方电缆	129,900	7,864,146.00	3.78
9	H00700	腾讯控股	15,700	6,709,360.46	3.22
10	000811	冰轮环境	342,600	5,899,572.00	2.83

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。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

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。

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。基于审慎原则，本基金管理人披露以下事项：

赣锋锂业：2025年12月30日，江西赣锋锂业集团股份有限公司发布《关于收到宜春市公安局移送起诉告知书的公告》，上述文件显示，公司于2025年12月29日收到宜春市公安局的移送起诉告知书：因涉嫌内幕交易罪单位犯罪，本案件已移送检察机关审查起诉。本次事项系在江西证监局2024年7月行政处罚的基础上，依法开展的后续正常司法程序。

本基金管理人就上述公司受调查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预计对公司正常经营不会产生重大、实质性影响，本次涉案事项为公司前期已披露的特定历史事件，预计不会影响公司正常的生产经营。

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	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,311.35
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	34,311.35

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

报告期期初基金份额总额	278,557,082.74
报告期期间基金总申购份额	1,412,363.51
减：报告期期间基金总赎回份额	70,933,592.14
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	209,035,854.11

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

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,002,750.31
------------------	--------------

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	9,002,750.31
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	4.31

注：报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）=期末持有该类别的份额/期末产品该类别的总份额*100%

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未发生运用固有资金投资本基金的交易。

§8 报告期末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额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,002,750.31	4.31%	9,002,750.31	4.31%	自基金合同生效之日起不少于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	5,021,290.93	2.40%	5,021,290.93	2.40%	自基金合同生效之日起不少于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	14,024,041.24	6.71%	14,024,041.24	6.71%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无其他影响投资者决策的重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予朱雀碳中和三年持有期混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《朱雀碳中和三年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《朱雀碳中和三年持有期混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《朱雀碳中和三年持有期混合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碳中和三年持有期混合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

10.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人的办公场所

10.3 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

2026年04月22日