

---

# 朱雀企业优胜股票型证券投资基金

## 2024年第2季度报告

### 2024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:2024年07月19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2024年7月11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2024年04月01日起至2024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 | 745,198,875.16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 | 593,341,942.41份  | 151,856,932.75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(2024年04月01日 - 2024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 | -10,987,961.74                 | -3,366,031.62 |

|                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|
| 2.本期利润         | -36,401,557.04 | -9,659,732.77  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0593        | -0.0558        |
| 4.期末基金资产净值     | 622,373,276.79 | 154,288,601.43 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0489         | 1.0160         |

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      | -5.53%  | 1.06%     | -0.48%     | 0.59%         | -5.05%  | 0.47% |
| 过去六个月      | -13.80% | 1.36%     | 1.86%      | 0.71%         | -15.66% | 0.65% |
| 过去一年       | -20.71% | 1.13%     | -6.80%     | 0.69%         | -13.91% | 0.44% |
| 过去三年       | -37.36% | 1.26%     | -26.33%    | 0.84%         | -11.03% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.89%   | 1.32%     | -7.92%     | 0.89%         | 12.81%  | 0.43% |

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   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -5.72%  | 1.06%     | -0.48%     | 0.59%         | -5.24%  | 0.47% |
| 过去六个月      | -14.14% | 1.36%     | 1.86%      | 0.71%         | -16.00% | 0.65% |
| 过去一年       | -21.34% | 1.13%     | -6.80%     | 0.69%         | -14.54% | 0.44% |
| 过去三年       | -38.84% | 1.26%     | -26.33%    | 0.84%         | -12.51% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.60%   | 1.32%     | -7.92%     | 0.89%         | 9.52%   | 0.43% |

### 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05月22日-2024年06月30日)



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  
(2020年05月22日-2024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  | -    | 17.5   | 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、朱雀产业智选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。 |
| 陈飞  | 公募投资部基金经理  | 2023-08-09  | -    | 7.5    | 陈飞，经济学硕士。曾任职于上海光大证券资产管理有限公司。现任公司公募投资部基金经理，担任朱雀企业优胜股票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合规守信情况的说明

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，在防范投资风险的基础上，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

2024年二季度，A股市场经历了先扬后抑的走势，5月下旬前市场震荡上行并创出阶段性高点，之后市场则震荡下行调整。产品操作层面，今年以来我们总体上在仓位上相对保守，进入6月，伴随市场调整，我们适当提升了产品仓位。

在一季度市场展望分析中，我们曾经指出市场经历三年多的调整，已经在孕育新的变化。二季度以来，我们看到市场主要指数在5月中下旬创出了阶段性高点，但之后又经历了比较快的调整。站在目前时点，我们倾向于认为，指数进一步向下调整的空间有限，随着产业趋势的逐步清晰，市场风格也将从红利转为成长。

历届三中全会聚焦领域均为长期改革方向，承担着推动经济发展和体制改革的使命，包括改革开放、社会主义市场经济体制、农村改革等重磅主题的确立和完善，起到描绘经济发展和经济改革思路窗口的重要作用。本次三中全会最重要的极有可能是稳定市场对于长期经济发展方向的预期，改革重点内容可能包括创新体制改革（加快培育新质生产力）、财税体制改革（释放地方活力）、金融体制改革（培育耐心资本）和新一轮国企改革（提高核心竞争力、增强核心功能）等。因此，二十届三中全会作为重点研究全面深化改革、推进中国式现代化的关键会议，其落地本身具有重要的历史意义。

下半年地方债发行较为集中，实物工作量形成也将较大概率有所加速；6月21日财政部等四部门明确中央财政会同有关方面实施设备更新贷款财政贴息政策，这有望对上半年增速已经较高的设备更新投资“空中加油”；地产投资正处于新一轮升温过程中，以上三个方面均会对下半年经济形成支撑。在一定程度上“收储”是有利于打通“库存-价格-预期”的关键链条的，在集中推进的情况下，有可能带来较积极的效果。

最后，伴随着产业趋势的逐步清晰，市场风格或将从红利转为成长。观察今年的景气度变化，成长风格景气度已现企稳的信号，其中，电子、半导体、医药、新能源等在供需格局改善和出清的中后期，部分板块未来成长风格或将阶段性反弹占优，而持续性的反转有待成长板块需求和业绩的趋势性好转。

具体到行业结构上，发展新质生产力是推动高质量发展的内在要求和重要着力点。2023年，从通用大模型的喧嚣到行业大模型的集中落地，AI应用创新在下半年呈爆发式涌现；2024年，AI应用的颗粒度正在进一步细化，关注点和效用也更实际，正进一步走进垂直细分领域的价值实现。对于大多数产业及其中的企业来说，转变技术范式、突破传统模式发展是更现实的挑战，以AI赋能现有的技术、业务是最现实的命题之一，也是最具效率、落地速度最快的路径之一。

电子半导体方面，2023H2基本宣告周期拐点确立，2024年换机周期、产品创新等成为终端出货量恢复增长的推动力。Comuptex 2024展会以“Connecting AI”为主旨，2024年有望成为AI PC/AI手机元年，头部厂商对设备端AI的规划相对去年更加清晰。AI带来的好的体验有可能带动整个智能手机行业的换机潮。半导体代工方面，智能手机温和复苏、AI数据中心需求强劲；国内头部晶圆代工厂的产能利用率提升大概率是确定的，且景气度的可见度也是在提升；我们积极把握晶圆代工行业的景气度提升，以及期待在先进制程上的突破。

AI应用和产品方面，我们逐步加大关注度，认为产业链大概率会逐步从“All in AI”来到“AI in All”。AI算法的本质是数学的概率分布，算法会有先发优势，但终归极有可能会外溢和普及；国内的通义千问、混元大模型等模型也在技术上实现“好用”。算法API接口的价格降低，也有望持续降低市场门槛，在一定程度上利好应用层繁荣。全球AI关注度进一步延伸到用户+场景+数据。展望下半年，AI产品创新不断，我们认为AI会是一个资本密集、人才密集、数据密集的产业，我们寻找和布局具备“场景-数据-模型”飞轮效应的企业。

智能车和机器人方面，高阶智能驾驶进程加快。2024年以来城市NOA加速发展，驱动自动驾驶向端到端发展，我们积极把握国内智能车及产业链相关的布局机会。

新型电力系统领域方面，新能源的平价带来电源侧投资。平价之后，核心矛盾从如何让新能源实现平价到如何让新能源稳定运行，即解决消纳矛盾，那么大概率更加依靠电网投资、储能。光伏新技术进一步带来更高转化效率，有利于加快落后产能出清。我们高度关注电改给予绿电合理的收益率，即电能量市场的公平竞争以及合理的绿色价值。

消费品行业分化明显。以潮玩、宠物、美妆为代表的消费在基本面持续向好情况下估值有抬升趋势。以白酒为代表的传统消费品二季度整体表现相对一般，潮玩、宠物与美妆属于能够为消费者提供较强情绪价值的消费品，行业整体规模也在持续提升，格局持续优化。我们会对此类消费品持续跟踪关注。

朱雀基金致力于成长股的挖掘，在新能源产业方面有较强的研究积累，我们将密切关注新能源制造环节供给侧结构性改革的进展，积极把握产能出清和新技术变革带来的布局机会；同时我们将深入在能源变革领域的研究，围绕新型电力系统建设在电源侧、电网侧和用户侧积极布局，在氢能、新型储能等方面积极拓展。此外，我们在AI产业的上中下游、农业、医疗服务美护等方面也在积极研究布局，努力把握产业发展脉络，拥抱相关领域成长带来的机会。

#### 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1.0489元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.53%，同期业绩比较基准收益率为-0.48%；截至报告期末朱雀企业优胜C基金份额净值为1.0160元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.72%，同期业绩比较基准收益率为-0.48%。

#### 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<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 679,962,217.64 | 86.28            |
|    | 其中：股票             | 679,962,217.64 | 86.28            |
| 2  | 基金投资              | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 55,920,035.56  | 7.10             |
|    | 其中：债券             | 55,920,035.56  | 7.10             |
|    | 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          | 35,111,000.00  | 4.45             |
|    | 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 | 15,790,536.47  | 2.00   |
| 8 | 其他资产         | 1,343,920.63   | 0.17   |
| 9 | 合计           | 788,127,710.30 | 100.00 |

注：权益投资中港股通股票公允价值为199,839,682.67元，占基金总资产比例25.36%。

## 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         | 18,227,132.00  | 2.35         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 402,531,831.17 | 51.83        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 154,995.12     | 0.02         |
| E  | 建筑业              | 151,698.00     | 0.02         |
| 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  | 52,945,854.28  | 6.82         |
| 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          | 3,434,441.40   | 0.44         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 2,676,583.00   | 0.34         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 480,122,534.97 | 61.82        |

## 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 | 54,198,488.73  | 6.98         |
| 日常消费品    | 36,933,613.22  | 4.76         |
| 医疗保健     | 2,058,841.80   | 0.27         |
| 工业       | 11,765,412.64  | 1.51         |
| 信息技术     | 73,128,265.96  | 9.42         |
| 通讯业务     | 4,962,277.67   | 0.64         |
| 公用事业     | 16,792,782.65  | 2.16         |
| 合计       | 199,839,682.67 | 25.73        |

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  | H00981 | 中芯国际   | 4,097,000 | 64,015,959.32 | 8.24         |
| 2  | 002028 | 思源电气   | 754,300   | 50,462,670.00 | 6.50         |
| 3  | 000792 | 盐湖股份   | 2,437,000 | 42,525,650.00 | 5.48         |
| 4  | H02367 | 巨子生物   | 882,600   | 36,933,613.22 | 4.76         |
| 5  | 688333 | 铂力特    | 713,243   | 34,556,623.35 | 4.45         |
| 6  | 603606 | 东方电缆   | 647,893   | 31,623,657.33 | 4.07         |
| 7  | 300776 | 帝尔激光   | 674,359   | 30,993,539.64 | 3.99         |
| 8  | H02015 | 理想汽车—W | 426,300   | 27,352,006.53 | 3.52         |
| 9  | H02020 | 安踏体育   | 392,200   | 26,846,482.20 | 3.46         |
| 10 | 300751 | 迈为股份   | 221,000   | 26,405,080.00 | 3.40         |

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 | 55,920,035.56 | 7.20         |
| 2  | 央行票据 | -             | -            |

|    |           |               |      |
|----|-----------|---------------|------|
| 3  | 金融债券      | -             | -    |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -    |
| 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        | 55,920,035.56 | 7.20 |

### 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  | 019727 | 23国债24 | 549,210 | 55,920,035.56 | 7.20         |

**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**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

**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    | 1,318,472.70 |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 25,447.93    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 1,343,920.63 |

### 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                   | 628,950,449.61 | 185,360,482.36 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 2,102,822.77   | 30,024,482.38  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 37,711,329.97  | 63,528,031.99  |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额                   | 593,341,942.41 | 151,856,932.75 |

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         | 5,130,836.33 | -       |
| 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         | 5,130,836.33 | -       |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.86         | -       |

## 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

本基金本报告期内无其他影响投资者决策的重要信息。



## §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](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  
2024年07月19日