
朱雀企业优选股票型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09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:2024年10月25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2024年10月17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07月01日起至2024年09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	2,345,851,946.06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	2,013,850,793.46份	332,001,152.60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07月01日 - 2024年09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	-148,505,697.05	-24,139,148.26
2.本期利润	170,917,226.83	26,890,436.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0834	0.0799
4.期末基金资产净值	1,755,315,005.53	280,217,993.38
5.期末基金份额净值	0.8716	0.8440

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	10.99%	1.60%	13.31%	1.32%	-2.32%	0.28%
过去六个月	4.27%	1.36%	12.24%	1.06%	-7.97%	0.30%
过去一年	-7.23%	1.32%	7.48%	0.96%	-14.71%	0.36%
过去三年	-28.41%	1.33%	-12.97%	0.93%	-15.44%	0.40%
自基金合同生效起至今	-12.84%	1.32%	-8.24%	0.93%	-4.60%	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
过去三个月	10.76%	1.60%	13.31%	1.32%	-2.55%	0.28%
过去六个月	3.85%	1.36%	12.24%	1.06%	-8.39%	0.30%
过去一年	-7.97%	1.32%	7.48%	0.96%	-15.45%	0.36%
过去三年	-30.11%	1.33%	-12.97%	0.93%	-17.14%	0.40%
自基金合同生效起至今	-15.60%	1.32%	-8.24%	0.93%	-7.36%	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-2024年09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-2024年09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	离任		

		日期	日期		
梁跃军	公司总经理/基金经理	2020-09-23	-	18	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，担任朱雀企业优选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。
郭涛	公募投资部基金经理	2023-10-13	-	4	郭涛，工学硕士。先后任职于上海伟本自动化有限公司、上海汽车集团股份有限公司技术中心和申港证券股份有限公司。现任公司公募投资部基金经理，担任朱雀企业优选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年三季度，A股市场于9月下旬迎来转机，在政策强力推动下，主要指数较短时间内完成了20%-40%的上涨幅度，交易量也急剧放大。产品操作层面，面对大幅上涨的市场，我们优化了产品仓位。

在今年中期报告中我们指出：A股市场经历了三年多的调整，已经在震荡筑底并孕育新的变化。站在目前时点（7月），我们倾向于认为，二十届三中全会绘就的改革蓝图将提升市场风险偏好，随着后续经济基本面的逐步改善，市场风格也可能从红利转为成长。

9月24日“一行一局一会”宣布了一揽子逆周期调节政策，从宽货币、托地产、稳股市等方面提出措施；9月26日，中央政治局召开会议，罕见讨论经济形势，释放更积极的信号，股票市场也给出积极反馈。

本轮市场上涨后，我们怎么应对？

首先我们看下市场之前连续缩量下跌的原因。价格负反馈通缩环境下微观主体主动缩减资产负债表，居民减少按揭贷款消费贷款增加储蓄应对未来不确定性导致消费需求降低；企业竞争激烈产品价格下跌经营效益下降主动降杠杆导致企业投资需求缩小；房价下跌、销售缩量，房地产投资连续负增长影响整体投资需求；地方政府财力受房地产

影响需要化解地方债务（降杠杆）；此外，尽管中央一再强调“两个毫不动摇”，但企业家精神并未充分发挥，经济活力仍有进一步释放空间。

接下来我们分析下9月下旬出台政策的影响。从924金融口三部门出台的政策和926政治局会议精神来看，意味着政策层面的大转向，可以说相关政策出在了根节上，因此市场会有如此剧烈的反应。价格负反馈的通缩环境是股市下跌的宏观层面原因，9月下旬的政策出发点就是要打破这个价格负反馈机制，着眼点是股价和房价为代表的资产价格，通过强力政策提振资本市场并促进房地产市场止跌回稳。在提振资本市场方面，央行创设的两个结构性货币政策工具意义重大。一个是互换便利，一个是股票回购专项再贷款。互换便利主要是为券商、保险和基金等金融机构加杠杆投资股票提供资金便利，股票回购专项再贷款主要是为上市公司及其大股东增持回购公司股票提供资金，央行作为资金提供方。央行创设的这两个结构性货币政策工具为市场提供了场外新增资金的可能，打破了此前的股价负循环。在促进房地产市场止跌回稳方面，降准、降息等政策迅速落地，特别是商业银行下调存量房贷利率，有利于进一步降低借款人房贷利息支出，预计这一项政策将惠及5000万户家庭，1.5亿人口，平均每年减少家庭利息支出总数约1500亿元。这有助于促进扩大消费和投资，也有利于减少提前还贷行为，一定程度上阻断居民资产负债表的收缩，维护房地产市场平稳运行。

关于市场期待的财政政策，迄今为止我们看到926政治局会议层面的表述，“要加大财政货币政策逆周期调节力度，保证必要的财政支出。要发行使用好超长期特别国债和地方政府专项债，更好发挥政府投资带动作用。”926政治局会议指出“要帮助企业渡过难关，进一步规范涉企执法、监管行为。要出台民营经济促进法，为非公有制经济发展营造良好环境。”中央自上而下再次表明了态度。在政策落实方面，“会议要求，各地区各部门要认真贯彻落实党中央决策部署，干字当头、众志成城，充分激发全社会推动高质量发展的积极性主动性创造性，推动经济持续回升向好。”

从以上分析我们可以看出，9月末出台的一系列政策针对性极强，提振资本市场并促进房地产市场止跌回稳是核心目标，打破价格负反馈机制的通缩预期，在政策层面可以说是大转向，资本市场本身的表现也是对政策的充分肯定。影响资本市场的关键是信心和预期，预期好转信心增强使得市场表现得非常积极。

就短期市场表现而言，A股主要指数迅速增长，从估值水平看，主要指数TTM市盈率水平已经修复到接近或者超过历史中枢位置。就上证指数而言，再涨10%就是3700点左右，回到了2021年春节时的高点，彼时中国应对疫情初战告捷，产业链供应链完整出口大增填补全球供应短缺，新能源等产业处在景气高点，是内外预期都相当好的时期。创业板指数离2021年高点距离比较远，是受新能源、医药等权重股产业周期影响所致。

市场是否能持续走牛需要经济基本面的整体好转、企业盈利的明显上升和微观主体自发的积极性主动性创造性的开展工作。

我们知道，926政治局会议提出要促进房地产市场止跌回稳，房地产下滑对中国经济的影响是相当大的，房价下跌对通缩预期有重要影响。经过利率调降，现在一线城市房贷利率水平为3.4%，现实中房贷利率调降又受到商业银行利差缩小的掣肘，房贷利率

进一步调降是趋势，但时间上会经历曲折。企业盈利的明显上升需要创造性的开展工作，需要企业家精神的进一步提升，需要地方和有关部门进一步贯彻落实执行中央精神。

财政政策方面，政治局会议表示将保证必要的财政支出。我们认为财政政策力度会综合考虑缺口和今年增长目标来定；美国大选尚未落地，未来外部还面临很多不确定性，财政是经济大盘的托底项，为应对不确定的未来，为改革创新和新产业崛起留有余地。

政策转向表明了中国政府的积极态度，正视通缩并采取有力措施，宏观经济失速风险降低。我们投资研究将在这种大的背景下展开，积极关注产业层面的变化，提振资本市场一定会有一批代表中国核心竞争力的优质公司崛起，科技（AI）、生物制药、新技术推动的新能源变革、民生相关的农业、新型消费、医疗美护等都值得我们去深度挖掘。在公司选择层面，我们将更加注重公司治理（重视股东回报）优秀、财务稳健、竞争格局清晰和企业家精神十足的高质量发展公司。为后续中长期布局资本市场做好准备。

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0.8716元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.99%，同期业绩比较基准收益率为13.31%；截至报告期末朱雀企业优选C基金份额净值为0.8440元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.76%，同期业绩比较基准收益率为13.31%。

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	1,628,356,438.12	79.81
	其中：股票	1,628,356,438.12	79.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	63,165,018.08	3.10
	其中：债券	63,165,018.08	3.10
	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	243,704,138.69	11.94
	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	91,001,085.69	4.46
8	其他资产	14,179,778.94	0.69
9	合计	2,040,406,459.52	100.00

注：权益投资中港股通股票公允价值为509,698,277.55元，占基金总资产比例24.98%。

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	26,825,967.00	1.32
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,058,959,317.57	52.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	32,872,876.00	1.61
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	1,118,658,160.57	54.96
--	----	------------------	-------

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	151,437,026.57	7.44
日常消费品	94,428,631.27	4.64
工业	36,056,630.29	1.77
信息技术	123,021,222.38	6.04
通讯业务	31,673,930.89	1.56
公用事业	73,080,836.15	3.59
合计	509,698,277.55	25.04

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	000792	盐湖股份	10,095,543	187,373,278.08	9.21
2	002028	思源电气	2,146,233	158,606,618.70	7.79
3	300776	帝尔激光	2,507,884	150,473,040.00	7.39
4	688333	铂力特	2,181,877	113,915,798.17	5.60
5	H00981	中芯国际	5,398,500	101,504,332.62	4.99
6	H02367	巨子生物	2,055,200	94,428,631.27	4.64
7	603606	东方电缆	1,576,200	86,958,954.00	4.27
8	H02020	安踏体育	913,400	77,797,991.43	3.82
9	002311	海大集团	1,596,451	76,661,577.02	3.77
10	H02015	理想汽车—W	755,400	73,639,035.14	3.62

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	63,165,018.08	3.10
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	63,165,018.08	3.10

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	618,000	63,165,018.08	3.10

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

东方电缆：2024年9月2日，宁波证监局发布《行政监管决定书[2024]39号》，上述文件显示，宁波东方电缆股份有限公司因未履行信披义务，被责令改正并记入诚信档案。

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	10,693,960.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,485,818.16
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,179,778.94

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

	朱雀企业优选A	朱雀企业优选C
报告期期初基金份额总额	2,091,705,764.37	341,421,559.34
报告期期间基金总申购份额	6,710,674.83	852,984.19
减：报告期期间基金总赎回份额	84,565,645.74	10,273,390.93
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	2,013,850,793.46	332,001,152.60

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	6,785,181.16	-
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	6,785,181.16	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.34	-

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）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10月25日