

---

# 朱雀产业臻选混合型证券投资基金

## 2020年第4季度报告

### 2020年12月31日

基金管理人:朱雀基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2021年01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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月18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2020年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 朱雀产业臻选   |
| 基金主代码      | 007493   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2019年06月27日  |
| 报告期末基金份额总额 | 2,506,666,851.80份  |
| 投资目标       | 在严格控制控制风险的前提下，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> |

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。

#### （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

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>(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。</p> <p>(4) 港股通标的股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>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> |
| 业绩比较基准 | <p>沪深300指数收益率*50%+中证港股通综合指数收益率*10%+中债综合指数收益率*40%</p>   |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金, 其风险和预期收益水平高于</p>   |

|                 |   |                 |
|-----------------|---|-----------------|
|                 | 债券型基金及货币市场基金，而低于股票型基金。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。 |                 |
| 基金管理人           | 朱雀基金管理有限公司  |                 |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 朱雀产业臻选A   | 朱雀产业臻选C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 007493  | 007494          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,800,209,402.36份   | 706,457,449.44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(2020年10月01日 - 2020年12月31日) |                  |
|-----------------|--------------------------------|------------------|
|                 | 朱雀产业臻选A                        | 朱雀产业臻选C          |
| 1. 本期已实现收益      | 104,105,013.27                 | 33,058,638.53    |
| 2. 本期利润         | 474,906,022.08                 | 165,523,043.96   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.3730                         | 0.3790           |
| 4. 期末基金资产净值     | 3,589,705,462.59               | 1,396,020,636.49 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.9940                         | 1.9761           |

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

朱雀产业臻选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 | 20.21% | 1.30%     | 8.22%      | 0.56%         | 11.99% | 0.74% |
| 过去六个月 | 48.33% | 1.56%     | 13.07%     | 0.75%         | 35.26% | 0.81% |

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | 81.57% | 1.59% | 14.21% | 0.82% | 67.36% | 0.77% |
| 自基金合同生效起至今 | 99.40% | 1.36% | 19.79% | 0.72% | 79.61% | 0.64% |

## 朱雀产业臻选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      | 20.03% | 1.30%     | 8.22%      | 0.56%         | 11.81% | 0.74% |
| 过去六个月      | 47.89% | 1.56%     | 13.07%     | 0.75%         | 34.82% | 0.81% |
| 过去一年       | 80.50% | 1.59%     | 14.21%     | 0.82%         | 66.29% | 0.77% |
| 自基金合同生效起至今 | 97.61% | 1.36%     | 19.79%     | 0.72%         | 77.82% | 0.64% |

注：

- 1、本基金建仓期为本基金合同生效之日（2019年6月27日）起6个月。
- 2、本基金的业绩比较基准 沪深300指数收益率\*50%+中证港股通综合指数收益率\*10%+中债综合指数收益率\*40%。
- 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

朱雀产业臻选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



朱雀产业臻选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



注：

- 1、本基金建仓期为本基金合同生效之日（2019年6月27日）起6个月。
- 2、本基金的业绩比较基准 沪深300指数收益率\*50%+中证港股通综合指数收益率\*10%+中债综合指数收益率\*40%。

## § 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 | 2020-06-29  | -    | 14     | 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，以及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的基金经理。  |
| 何之渊 | 公募投资部权益投资副总监/基金经理 | 2019-06-27 | - | 10 | 何之渊，数量经济学硕士。先后任职于中银基金管理有限公司，长江证券股份有限公司，银华基金管理有限公司，东方明珠新媒体股份有限公司，上海富善投资有限公司，上海涌津投资管理有限公司，西安朱雀丝路投资管理有限公司。现任公司公募投资部权益投资副总监，以及朱雀产业臻选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。 |

#### 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

报告期内公司严格执行《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

报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易、利益输送的异常交易行为。报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

经过10月份的震荡后，市场在11月、12月持续表现出比较强的上涨势头，创业板虽然震荡持续的时间长一些，在12月份创业板指数表现也比较好。四季度我们的产品净值上涨约20%，主要得益于我们重点布局的新能源产业链、电动车产业链、互联网龙头、苹果产业链和IOT产业龙头等股票表现较好。

自9月份以来，市场渐渐形成了国内国外经济将在2021年进入复苏的一致预期，分歧在于复苏拉动经济带来的业绩增长，对股市的促进作用更大，还是复苏引起通胀担忧后对股市的压制更大。我们预计，复苏带动通胀的程度整体可控。国内的固定资产投资在疫情期间刺激政策整体并不大，体现出政策定力，且后续地产政策受到“三条红线”等长期债务监控体系约束的情况下，预计对于通胀整体带动效果有限；在需求侧改革的政策思路下，PPI快速上行的概率也不高。预计总体不会对货币政策形成强制约。我们判断本轮经济扩张周期正进入补库存阶段，进入补库存阶段后，需求及产品价格环比见顶，整体呈现高位震荡，库存开始回升，伴随企业盈利充分释放，ROE进入主升阶段。预计PPI环比加速上涨将在一季度结束，但同比回升可能延续至2021年三季度，金融、地产、工业品等顺周期行业将迎来业绩高速增长。

展望明年和更长期角度，朱雀基金充满信心。从数据上看，A股市场已经连涨两年，但是估值分化度却在历史高位，齐涨齐跌现象不再；2020年退市公司蒸发市值再次创下了历史新高。大型、超大型市值公司在市场中的市值比重、成交金额比重不断上升，A股结构调整已初见成效。自1970年起美国经济开始转型，各行业集中度均明显提升，龙头股业绩开始占优。我国股市行业集中度提升始于2010年，自此龙头股业绩优势逐步显现。当前中国正处在产业结构转型期，经济发展目标从追求速度向追求效益、规模和质量转变，随着产权界定更加清晰、营商环境更加优化，资源配置的有效性将不断增强，各行业集中度也将迎来提升。龙头企业规模和盈利提高意味着A股龙头效应会继续强化。

2018年底朱雀基金提出突出“珍惜熊市”，集中重仓了能力圈内又好又便宜的优秀公司。2019年底我们认为熊牛转折特征明显，慢牛基础自上而下在于法治建设，土地、国企和金融供给侧等项改革推进，自下而上来自经过几十年改革开放的洗礼，市场在各个领域选择出的优秀龙头公司。判断2021年，美股更依赖刺激，A股则强调改革。推动高质量发展，构建新发展格局背景下，健全具有高度适应性、竞争力、普惠性的现代金融体系，叠加一批有国际竞争力的中国企业，和其背后价值观正、年富力强、为数不多的世界级企业家，不仅是推动经济转型的核心动力，更是推动整个社会螺旋式上升的正能量。朱雀基金期待在2021年“融入洪流”，融入时代正能量的洪流。我们将恪守参与人类社会升级进步的价值观，不断提升能力和格局，建设自身的生态圈，积极在太阳能、

新能源车、品牌消费、数字化商业流通、苹果产业链和IOT龙头、社交、金融科技、创新药和医疗服务等领域布局。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末朱雀产业臻选A基金份额净值为1.9940元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为20.21%，同期业绩比较基准收益率为8.22%；截至报告期末朱雀产业臻选C基金份额净值为1.9761元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为20.03%，同期业绩比较基准收益率为8.22%。

#### 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              | 3,964,329,374.45 | 77.31        |
|    | 其中：股票             | 3,964,329,374.45 | 77.31        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 180,767,962.10   | 3.53         |
|    | 其中：债券             | 180,767,962.10   | 3.53         |
|    | 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      | 798,494,940.43   | 15.57        |
| 8  | 其他资产              | 184,486,307.94   | 3.60         |
| 9  | 合计                | 5,128,078,584.92 | 100.00       |

注：权益投资中港股通股票公允价值为 1,506,211,038.37元，占基金总资产比例 29.37%。

#### 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         | 120,249,281.00   | 2.41          |
| B  | 采矿业              | -                | -             |
| C  | 制造业              | 1,796,769,223.75 | 36.04         |
| 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      | 357,908,930.79   | 7.18          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 96,224,289.54    | 1.93          |
| 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    | 86,966,611.00    | 1.74          |
| 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               | 2,458,118,336.08 | 49.30         |

### 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   | 227,728,594.61 | 4.57          |
| 非日常生活消 | 303,669,519.32 | 6.09          |

|      |                  |       |
|------|------------------|-------|
| 费品   |                  |       |
| 金融   | 258,053,523.45   | 5.18  |
| 医疗保健 | 179,270,834.95   | 3.60  |
| 信息技术 | 162,580,339.44   | 3.26  |
| 电信服务 | 374,908,226.60   | 7.52  |
| 合计   | 1,506,211,038.37 | 30.21 |

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 | 隆基股份  | 4,013,270  | 370,023,494.00 | 7.42         |
| 2  | H01772 | 赣锋锂业  | 2,922,000  | 227,728,594.61 | 4.57         |
| 2  | 002460 | 赣锋锂业  | 1,267,272  | 128,247,926.40 | 2.57         |
| 3  | H00700 | 腾讯控股  | 744,300    | 353,308,015.73 | 7.09         |
| 4  | 002352 | 顺丰控股  | 3,093,329  | 272,924,417.67 | 5.47         |
| 5  | 002311 | 海大集团  | 3,979,891  | 260,682,860.50 | 5.23         |
| 6  | H06886 | HTSC  | 25,131,800 | 258,053,523.45 | 5.18         |
| 7  | H01801 | 信达生物  | 2,596,000  | 179,270,834.95 | 3.60         |
| 8  | 600438 | 通威股份  | 4,510,211  | 172,611,795.54 | 3.46         |
| 9  | 600893 | 航发动力  | 2,878,412  | 170,833,752.20 | 3.43         |
| 10 | H01810 | 小米集团一 | 5,818,400  | 162,580,339.   | 3.26         |

|  |  |   |  |    |  |
|--|--|---|--|----|--|
|  |  | W |  | 44 |  |
|--|--|---|--|----|--|

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      | 10,377,962.10  | 0.21         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 170,390,000.00 | 3.42         |
|    | 其中：政策性金融债 | 170,390,000.00 | 3.42         |
| 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        | 180,767,962.10 | 3.63         |

#### 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  | 200309 | 20进出09 | 1,000,000 | 99,980,000.00 | 2.01         |
| 2  | 180212 | 18国开12 | 400,000   | 40,344,000.00 | 0.81         |
| 3  | 190212 | 19国开12 | 300,000   | 30,066,000.00 | 0.60         |
| 4  | 019627 | 20国债01 | 103,790   | 10,377,962.10 | 0.21         |

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 2020年4月13日，中国证券监督管理委员会江西监管局出具《关于对江西赣锋锂业股份有限公司采取出示警示函措施的决定》（[2020]2号）。警示问题：1. 未对重大投资进行内幕信息知情人登记；2. 内幕信息知情人登记不完整。

2020年2月10日，中国人民银行出具行政处罚决定书银罚字[2020]23号，对华泰证券股份有限公司进行公开处罚及责令整改。处罚事由：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定报送可疑交易报告；3. 与身份不明的客户进行交易。罚款金额1010万元。

其余证券的发行主体在报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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 | 77,000,011.20 |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| 3 | 应收股利  | -              |
| 4 | 应收利息  | 2,294,170.49   |
| 5 | 应收申购款 | 105,192,126.25 |
| 6 | 其他应收款 | -              |
| 7 | 其他    | -              |
| 8 | 合计    | 184,486,307.94 |

#### 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

| 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  | 600438 | 通威股份 | 7,476,438.54   | 0.15         | 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

|                               | 朱雀产业臻选A          | 朱雀产业臻选C        |
|-------------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 1,094,126,618.40 | 359,737,837.85 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 1,085,827,573.72 | 467,244,140.31 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 379,744,789.76   | 120,524,528.72 |
| 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                   | 1,800,209,402.36 | 706,457,449.44 |

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

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自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产业臻选混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《朱雀产业臻选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《朱雀产业臻选混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《朱雀产业臻选混合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产业臻选混合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01月22日