

---

朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金

2023年第4季度报告

2023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:2024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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年1月12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2023年10月01日起至2023年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	朱雀恒心一年持有
基金主代码	011531
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年03月01日
报告期末基金份额总额	5,720,385,284.75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>

## 2、股票投资策略

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

	<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> <p>7、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>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	中证800指数收益率*50%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*25%+中债综合全价(总值)指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益水平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

### §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（2023年10月01日 - 2023年12月31日）
1.本期已实现收益	-174,201,865.19
2.本期利润	-123,599,706.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0211
4.期末基金资产净值	4,345,657,149.11
5.期末基金份额净值	0.7597

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	-2.63%	0.86%	-4.64%	0.62%	2.01%	0.24%
过去六个月	-7.52%	0.82%	-7.89%	0.65%	0.37%	0.17%
过去一年	-10.13%	0.88%	-7.79%	0.64%	-2.34%	0.24%
自基金合同生效起至今	-24.03%	1.18%	-24.37%	0.82%	0.34%	0.36%

#### 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

朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金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（2021年3月1日）起6个月。
- 2、本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率\*50%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*25%+中债综合全价(总值)指数收益率\*25%。

## §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	2021-03-01	-	17	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。

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，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，组合间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%的情况共1次。投资组合经理因投资策略需要而发生该笔同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年四季度，A股市场延续了二季度以来的调整态势，主要指数下跌幅度加大，创出了年内的低点。政策层面比较积极，年末政治局会议和中央经济工作会议对明年经济工作做了部署但政策落地执行需要时间，市场表现为震荡寻底特征。产品操作层面，我们把握市场调整，立足2024年，优化持仓结构。

从宏观层面看，2024年稳增长的方略已经制定出台。2023年12月中旬，中央政治局会议和中央经济工作会议相继召开，对2024年经济工作做了总体部署。再次释放出稳增长信号、时隔两年再度提及以经济建设为中心。会议强调“坚持稳中求进、以进促稳、先立后破，多出有利于稳预期、稳增长、稳就业的政策”。要求“切实增强经济活力、防范化解风险、改善社会预期，巩固和增强经济回升向好态势”。会议还表示，必须坚持依靠改革开放增强发展内生动力，统筹推进深层次改革和高水平开放，不断解放和发展社会生产力、激发和增强社会活力。



对宏观政策，会议重申“要强化宏观政策逆周期和跨周期调节”，要求积极的财政政策要适度加力、提质增效，稳健的货币政策要灵活适度、精准有效。我们之前也提到，财政政策方面中央政府加杠杆的空间仍比较大，适度提高财政赤字率以稳定宏观经济大盘是宏观层面可以预期的选项，我们不用担心经济失速的风险。

从中观产业观察，会议将“以科技创新引领现代产业体系建设”放在2024年经济工作任务之首，凸显了“立”的意图，特别关注颠覆性技术和前沿技术催生的新产业、新模式、新动能。新型工业化、数字经济、人工智能等被寄予厚望，同时还要打造生物制造、商业航天、低空经济等若干战略性新兴产业，开辟量子、生命科学技术等未来产业新赛道。

“着力扩大国内需求”也是2024年经济工作的重点内容。在具体部署上，会议提出，推动消费从疫后恢复转向持续扩大，培育壮大新型消费，大力发展数字消费、绿色消费、健康消费，积极培育智能家居、文娱旅游、体育赛事、国货“潮品”等新的消费增长点。在传统消费领域继续提振新能源汽车、电子产品等大宗消费，要以提高技术、能耗、排放等标准为牵引，推动大规模设备更新和消费品以旧换新。会议部署2024年重点支持关键核心技术攻关、新型基础设施、节能减排降碳。

中央经济工作会议之后，会议新闻通稿全文16次提及“高质量发展”，提出新时代做好经济工作的“五个必须”规律性认识，并将“必须把坚持高质量发展作为新时代的硬道理”放在首位。对高质量发展的强调，显示了中央对经济转型发展的定力和决心，市场的反应另一方面也有对政策能否有效落地实施的关注。在724政治局会议后，中央自上而下已经出台了一系列政策，主要原因还是在落地执行方面。

我们看到，在2023年中央经济工作会议通稿里特别提到了四个抓落实：“要不折不扣抓落实，确保最终效果符合党中央决策意图。要雷厉风行抓落实，统筹把握时度效。要求真务实抓落实，坚决纠治形式主义、官僚主义。要敢作善为抓落实，坚持正确用人导向，充分发挥各级领导干部的积极性主动性创造性。”在以前的会议通报里我们还没有看到对落实环节这么强调，说明中央已经意识到政策落实的重要性，我们可以观察后续的变化出现。

以上我们着重分析了中央经济工作会议的一些信息，结合会议精神，站在目前时点看2024年，我们认为经济总量企稳是可以期待的。中央自上而下已经找到了激发和增强社会活力的方法，就是深化重点领域改革和抓政策的落地执行。对资本市场而言，2023年A股市场经历了普跌，年末上证指数在2900点附近徘徊，创业板指数则一度跌破1800点。展望2024年，考虑经济大盘稳定是前提，资金面相对宽裕，A股市场主要指数在连续两年下跌后已处于相对低位，市场向上的动力正在积蓄，结构机会精彩纷呈，我们对此已经做了充足的研究储备。

2023年12月中旬以来，光伏板块迎来久违的反弹，首先以逆变器为首，随后蔓延到整个光伏板块的普涨。一方面是11月的逆变器出口数据在连续5个月环比下滑后，首次转正。其中对欧洲逆变器出口环比降幅收窄，高库存逐步去化，另外如巴西等市场增长较好。部分逆变器公司给予24年一季度较为乐观的出货指引。另一方面，国家能源局公

布1-11月全国电力工业统计数据，11月我国光伏新增装机21.3GW，1-11月累计装机163.88GW，全年预期装机在190GW左右，延续高速增长。但本轮反弹核心还是光伏板块回调幅度足够大，wind光伏指数市盈率已经位于近9年0.5%以下的历史低位，供需矛盾带来的盈利下行预期已大部分反映在当前股价中。随着企业盈利见底及竞争格局趋于稳定，估值匹配后重新受到市场资金的关注。展望明年，从需求上，光伏渗透率远未到天花板，下一个重要阶段是光储平价到来，进一步打开需求天花板。供给侧已有相关积极信号的出现，融资收紧+新技术变革将共同推动行业供给侧改革。基于此，我们看好24年光伏行业的投资机会。一是光伏电池环节在产业链中技术进步空间依然较大，是未来光伏板块中机会较多的方向，长期来看，电池结构有望逐步向BC方向发展。二是寻找能够穿越周期的光伏行业龙头，头部企业自我造血能力更强，在手资金充足，市占率有望提升。三是围绕电力设备消纳环节，寻找确定性高成长赛道。

2023年在耐用消费品中，汽车销售是相对的亮点。1-11月，乘用车销量2322万辆，同比增长9.1%。其中，中国品牌乘用车销量1184万辆，同比增长20%，市场份额51%。在当前经济环境下，乘用车销量同比增长已相当不错，而结构表现更值得一提。自主品牌汽车在引领现在的汽车市场，自主品牌汽车在电动化、智能化等方面积极创新，可以说是通过供给侧的改进创造了新的需求，这个变化对产业链的影响将是持续深入的，我们会积极关注。

在科技方面，当前电子行业处于周期底部，库存低位+周期拐点，存储价格反映行业景气，Q3存储行业拐点已经到来；另外，台股IC设计公司的月度收入在最近几个月份已经实现同环比转正，封测业同比下滑中枢也已经收窄，行业已经进入去库存阶段，2024年行业向上复苏是大概率事件。产业链弹性来源于创新，包括终端创新和技术创新带来新工艺、新品类方向；同时，在多个下游应用领域，国内半导体行业迫切需要高水平的自主可控，我们也重点关注底层的制造能力。在新方向上，人工智能有望成为一个比PC、移动终端、互联网都更大的市场。从人机交互产生的价值来看，AI在感知、决策和执行环节都是有显著提升的。我们认为AI会是一个资本密集、人才密集、数据密集的产业，我们积极寻找具备“应用-数据-模型”飞轮效应的企业。我们看好传统软件公司受益于AI功能叠加所带来的付费率和客单价的提升，同时我们也重点关注如智能车和机器人所带来的新硬件载体的迭代创新，目前汽车高阶智驾渗透率仅为3-5%，随着主要厂商城市智驾试点的推广，2024年我们很可能看到高阶智驾渗透率的上升。同时，随着AI在各行各业的应用，我们相信医学、材料学、物理学等领域可能都会有飞跃的发展；在这个过程中，我们也挖掘一些服务于制造业高质量发展的产业数智化企业。

法国作家凡尔纳说：“但凡人能想象到的事物，必定有人能将它实现”。我们正在迈向新一轮科技创新，面对无穷的可能性，我们将聚焦产业趋势中的“不可或缺”，投资于“行业变革的推动者”，陪伴小树长成大树。具体到结构上，我们在数字经济、绿色经济和安全发展等相关领域持续耕耘，努力把握投资机会，可持续创造价值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末朱雀恒心一年持有基金份额净值为0.7597元，本报告期内，基金份额净值增长率为-2.63%，同期业绩比较基准收益率为-4.64%。

#### 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	3,662,176,365.48	83.96
	其中：股票	3,662,176,365.48	83.96
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	699,216,040.72	16.03
8	其他资产	562,036.02	0.01
9	合计	4,361,954,442.22	100.00

注：权益投资中港股通股票公允价值为643,748,402.12元，占基金总资产比例14.76%。

#### 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	34,093,052.00	0.78
C	制造业	2,207,011,496.90	50.79
D	电力、热力、燃气及水生	109,043,132.99	2.51

	产和供应业		
E	建筑业	127,744,902.66	2.94
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	27,245,679.20	0.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	294,256,401.77	6.77
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	51,813,861.74	1.19
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	34,670,233.78	0.80
R	文化、体育和娱乐业	132,549,202.32	3.05
S	综合	-	-
	合计	3,018,427,963.36	69.46

### 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	32,810,111.96	0.76
非日常生活消费品	201,996,283.94	4.65
日常消费品	128,936,039.13	2.97
工业	122,806,548.29	2.83
信息技术	157,199,418.80	3.62
合计	643,748,402.12	14.81

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	5,301,399	275,884,803.96	6.35
2	603063	禾望电气	10,504,865	262,621,625.00	6.04
3	688333	铂力特	1,984,559	226,260,672.20	5.21
4	H00981	中芯国际	8,734,500	157,199,418.80	3.62
5	300776	帝尔激光	2,547,935	153,538,563.10	3.53
6	600406	国电南瑞	6,558,311	146,381,501.52	3.37
7	600584	长电科技	4,573,702	136,570,741.72	3.14
8	H02020	安踏体育	1,978,800	135,837,031.30	3.13
9	000792	盐湖股份	8,503,246	135,626,773.70	3.12
10	600576	祥源文旅	17,815,753	132,549,202.32	3.05

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**

禾望电气：2023年10月30日，受到国家外汇管理局深圳市分局警告，处罚款人民币4.4万元。

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	512,123.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	49,912.13
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	562,036.02

### 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	688333	铂力特	57,720,167.10	1.33	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

报告期期初基金份额总额	5,989,552,987.33
报告期期间基金总申购份额	4,219,155.86
减：报告期期间基金总赎回份额	273,386,858.44
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	5,720,385,284.75

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

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,000,000.00
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	1,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.02

**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恒心一年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《朱雀恒心一年持有期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恒心一年持有期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

2024年01月22日