
朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2021年8月13日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本中期报告摘要摘自中期报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读中期报告正文。

本报告期自2021年03月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 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	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 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贵金属投资明细	50
7.9 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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1 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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	7,945,404,757.05份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	1、大类资产配置策略 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。 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、行业的使用寿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

	础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。 8、存托凭证投资策略 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。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		朱雀基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢琮	张燕
	联系电话	021-20305803	0755-83199084
	电子邮箱	xiecong@rosefinch.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-921-7211	95555
传真		021-20305999	0755-83195201
注册地址		西安经济技术开发区草滩生态产业园尚稷路8号一栋二楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区海阳西路555号/东育路588号前滩中心(前滩荟)第58层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		201204	518040
法定代表人		梁跃军	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正	www.rosefinchfund.com

文的管理人互联网网 址	
基金中期报告备置地 点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	朱雀基金管理有限公司	上海市浦东新区海阳西路555号/东 育路588号前滩中心（前滩荟）第58 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年03月01日（基金合同生效日）- 2021年06月30 日)
本期已实现收益	-23,336,330.72
本期利润	228,013,873.22
加权平均基金份额本期利润	0.0288
本期加权平均净值利润率	2.93%
本期基金份额净值增长率	2.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	-23,398,210.33
期末可供分配基金份额利润	-0.0029
期末基金资产净值	8,173,551,502.69
期末基金份额净值	1.0287
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	2.87%

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. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3. 上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（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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	份额净值 增长率①	份额净值 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
过去一个月	2.31%	0.50%	-0.75%	0.53%	3.06%	-0.03%
过去三个月	6.45%	0.51%	2.65%	0.62%	3.80%	-0.11%
自基金合同 生效起至今	2.87%	0.60%	0.06%	0.80%	2.81%	-0.20%

注：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%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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
(2021年03月01日-2021年06月30日)



注：本基金建仓期为本基金合同生效之日起6个月。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

朱雀基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2018】1496号文批准，并于2018年10月25日成立，其中朱雀股权投资管理有限公司出资占注册资本的65%，上海朱雀辛酉投资中心（有限合伙）出资占注册资本的35%。2019年3月28日，朱雀基金股东同比例增加出资额，注册资本变更为壹亿伍仟万元人民币。

截至2021年6月30日，公司旗下共管理着7只基金，分别为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、朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金、朱雀企业优胜股票型证券投资基金、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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
梁跃军	公司总经理/基金经理	2021-03-01	-	14.5	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的基金经理。
黄昊	公募投资部基金经理	2021-03-01	-	5.5	黄昊，产业经济学硕士。先后任职于上海壹德资产管理有限公司、中国投资咨询有限责任公司、朱雀股权投资管理有限公司和上海朱雀资产管理有限公司。现任公司公募投资部基金经理，担任朱雀企业优选股票型证券投资基金、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、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾今年上半年的市场表现，经历了2、3月份的急跌之后总体企稳反弹，在5月份出现了一轮较强的上涨，6月市场主要指数表现为震荡并有所调整。

产品操作层面，朱雀恒心一年持有成立于3月初，报告期内主要是产品建仓阶段。我们总体仓位有所保留，在一个偏震荡的市场里面，持仓结构的有效性是第一位的，我们并不急于把产品仓位提至很高，把握确定性投资机会是现阶段的主要操作思路

4.4.2 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1.0287元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.87%，同期业绩比较基准收益率为0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于未来市场的看法，我们维持A股市场表现为慢牛的观点。

向后展望，我们判断宏观经济景气度经历二季度高点后，下半年基本回到常规状态。经济从高速增长往中速增长阶段换挡基本结束，供求更为平衡。从中长期的结构性视角观察，全球通胀的中枢可能会有一定抬升。我国的货币政策经历了四年的宽松周期后，“跨周期”思路下央行货币政策从去年5月份就开始做出前瞻性调整，在其它主要经济体还在继续放水时，我们已经在做收缩，在经济过热前提前做调整。今年财政收入明显恢复，在财政政策蓄势待发、货币空间有限的情况下，广义财政可能会在未来承担更多稳增长的职能，债务周期也可能会在今年年底再度进入扩张周期，以保证经济增速保持在合理区间内。

关于通胀，央行货币执行报告认为全球大宗商品价格上涨可能阶段性推升我国PPI，但输入性通胀的风险总体可控。我国在去年应对疫情时坚持实施正常的货币政策，没有搞大水漫灌，经济发展稳中向好，保持了总供求基本平衡，不存在长期通胀或通缩的基础。鉴于市场一直担心央行收紧流动性来应对通胀，而央行清晰表达了不担心通胀的扩散和持续性，因此市场的担忧逐步消除。

此外，国常会部署做好大宗商品保供稳价工作，保持经济平稳运行。商品受到政策强力打压后出现明显回落，未来应会逐步回归基本面走势。从国内情况来看，5月份PPI已见顶，未来同比数据应该会下降。另一个指标CPI主要的影响因素猪价处于下降趋势，所以整体国内通胀压力不大。关于海外通胀情况，美国10年期国债收益率最近在缓慢回落，意味着美国整体经济复苏较弱，经济增长、解决就业是美国当前的主要关注点。

总体来看，我们认为宏观调控部门跨周期调节将保持经济平稳运行，未来我们会面临比较稳定的宏观环境。在此背景下，我们投资策略将更加注重自下而上根据产业景气变化来指导投资实践，在景气度最高的产业环节优选核心标的。

具体来讲，光伏领域我们看好上游材料环节和下游光伏新的应用环节。新能源汽车板块在高景气度下二季度表现比较充分，我们预计未来销量增速将逐步下行，好的行业也需要一个相对合理的价格，所以我们在投资上会有一些取舍。在下半年宏观经济整体走弱的情况下，大类行业里军工基本面最为确定，我们会持续关注。对电子制造我们依然看好，主要公司业绩增长确定性高而估值相对合理。考虑未来成长的确定性，并结合产业政策变化，我们关注生物医药的创新型公司和诊断服务领域的优质企业。金融服务领域，对大资管时代能够充分把握财富管理机遇并提供综合性服务的企业我们积极关注。我们坚定看好农业领域竞争格局清晰、增长确定的公司。此外，我们在汽车智能化、商业航天、半导体领域、品牌消费等方面也做了相应的研究准备。

总结来看，我们认为市场将回到慢牛轨道，没有大的宏观风险，在相对稳定的环境下，未来一批拥有全球竞争力的中国企业和中国企业家值得我们高度重视。对投资而言，

关键是提前发现和支持这些产业发展中的赢家，我们将集中精力自下而上挖掘结构性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，公司估值委员会成员包括公司总经理、督察长、监察稽核部负责人、研究部负责人、固定收益负责人、基金运营部负责人等相关专业人士组成。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议、经公司总经理办公会审议批准后执行。在每个估值日，本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人会对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配情况，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	2,451,523,625.75
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	4,112,594,435.87
其中：股票投资		3,810,319,693.07
基金投资		—
债券投资		302,274,742.80
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,612,980,645.00
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	5,165,493.57
应收股利		861,942.35

应收申购款		1,958,272.93
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		8,185,084,415.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		—
应付管理人报酬		9,810,152.31
应付托管费		1,635,025.40
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	—
应交税费		21.95
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	87,713.12
负债合计		11,532,912.78
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	7,945,404,757.05
未分配利润	6.4.7.10	228,146,745.64
所有者权益合计		8,173,551,502.69
负债和所有者权益总计		8,185,084,415.47

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额7,945,404,757.05份，基金份额净值人民币1.0287元。

6.2 利润表

会计主体：朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年03月01日（基金合同 生效日）至2021年06月30 日
一、收入		282,321,968.28
1. 利息收入		16,396,166.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,773,948.06
债券利息收入		2,309,387.61
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		10,312,831.18
证券出借利息收入		—
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,575,597.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,965,587.63
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	1,781,856.54
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—
股利收益	6.4.7.16	8,828,153.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	251,350,203.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		—
减：二、费用		54,308,095.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	38,614,378.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,435,729.84

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.18	9,169,173.99
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3.02
7. 其他费用	6.4.7.19	88,809.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		228,013,873.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		228,013,873.22

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,908,730,992.68	-	7,908,730,992.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	228,013,873.22	228,013,873.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	36,673,764.37	132,872.42	36,806,636.79
其中：1. 基金申购款	36,673,764.37	132,872.42	36,806,636.79
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-

生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	7,945,404,757.05	228,146,745.64	8,173,551,502.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

梁跃军

赵霞

樊安

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人朱雀基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2021]264号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为7,908,730,992.68份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第00097号的验资报告。基金合同于2021年3月1日生效。本基金的基金管理人为朱雀基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票(含存托凭证资产)占基金资产的比例为50%-95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以

后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及自2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、

通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转入、转出、类别调整等引起的基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可根据实际情况进行收益分配，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4) 每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人作为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	273,768.34
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	2,451,249,857.41
合计	2,451,523,625.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,559,180,846.04	3,810,319,693.07	251,138,847.03
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	302,063,385.89	302,274,742.80	211,356.91
	银行间市场	—	—	—
	合计	302,063,385.89	302,274,742.80	211,356.91
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		3,861,244,231.93	4,112,594,435.87	251,350,203.94

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,612,980,645.00	—
银行间市场	—	—
合计	1,612,980,645.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	26.60
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	317,733.71
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	4,024,486.89
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	823,105.50
应收申购款利息	140.87
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	—
合计	5,165,493.57

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	35,882.64
预提费用-信息披露费	51,830.48
合计	87,713.12

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,908,730,992.68	7,908,730,992.68
本期申购	36,673,764.37	36,673,764.37
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,945,404,757.05	7,945,404,757.05

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-23,336,330.72	251,350,203.94	228,013,873.22
本期基金份额交易产生的变动数	-61,879.61	194,752.03	132,872.42
其中：基金申购款	-61,879.61	194,752.03	132,872.42
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,398,210.33	251,544,955.97	228,146,745.64

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
活期存款利息收入	308,289.93
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,465,517.26
结算备付金利息收入	-
其他	140.87
合计	3,773,948.06

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出股票成交总额	1,834,512,060.71
减：卖出股票成本总额	1,830,546,473.08
买卖股票差价收入	3,965,587.63

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年 06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,781,856.54
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,781,856.54

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,725,120.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,942,400.00
减：应收利息总额	863.46
买卖债券差价收入	1,781,856.54

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	8,828,153.32
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	8,828,153.32

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	251,350,203.94

——股票投资	251,138,847.03
——债券投资	211,356.91
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	251,350,203.94

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
交易所市场交易费用	9,169,173.99
银行间市场交易费用	—
合计	9,169,173.99

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
审计费用	35,882.64
信息披露费	51,830.48
证券出借违约金	—
汇划手续费	696.14
开户费	400.00

合计	88,809.26
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
朱雀基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	38,614,378.95
其中：支付销售机构的客户维护费	19,408,959.52

注：支付基金管理人朱雀基金的基金管理费按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,435,729.84

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产×0.2%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未发生与通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未发生与通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
基金合同生效日（2021年03月01日）持有的基金份额	3,932,934.89
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	5,095,088.09
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	9,028,022.98
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月01日（基金合同生效日）至2021年06月30日
-------	--

	期末余额	当期利息收入
招商银行 股份有限 公司	273,768.34	308,289.93

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

2021年3月2日，本基金购买了托管人招商银行股份有限公司在上海证券交易所发行的股票招商银行（股票代码600036），买入数量2403997股，买入金额118700615元。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位：股）	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
6002 48	陕西 建工	2021 -04- 26	2021 -10- 22	非公 开发 行限 售	3.53	4.16	7,082, 153	25,0 00,0 00.0 9	29,4 61,7 56.4 8	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规、中国证监会规定和公司各项规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；建立符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，确保公司经营管理目标和发展战略的实现；建立行之有效的风险控制机制。在有效控制风险的前提下，确保基金持有人利益最大化，并保证基金持有人的合法权益不受侵犯。强化风险管理、防范各类风险，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整，实现公司稳健、持续发展，维护股东权益，维护公司信誉，树立良好的公司形象，及时高效地配合监管部门工作。

在董事会领导下，本基金管理人建立了架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。公司风险控制体系由公司董事会、合规风控委员会、督察长、管理层、风险控制委员会、监察稽核部和各风险控制部门组成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用资质降低导致债券价格下降的风险，也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

本基金管理人计划投资于具有良好信用等级的证券，且通过控制不同等级债券的投资比例以分散信用风险。公司建立了内部评级体系和交易对手库，对信用债券库内品种进行动态跟踪和整体回顾，对交易对手库进行日常维护和监控，并根据实际情况及时做出调整，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日
A-1	—
A-1以下	—

未评级	282,824,368.20
合计	282,824,368.20

注：未评级债券为债券期限在1年以内的国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日
AAA	—
AAA以下	—
未评级	19,450,374.60
合计	19,450,374.60

注：未评级债券为债券期限在1年以上的国债、政策性金融债等无信用评级债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期内无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,451,523,625.75	-	-	-	-	-	2,451,523,625.75
交易性金融资产	-	19,450,374.60	282,824,368.20	-	-	3,810,319,693.07	4,112,594,435.87
买入返售金融资产	1,612,900,000.00	-	-	-	-	-	1,612,900,000.00
应收利	-	-	-	-	-	5,165,493.57	5,165,493.57

息							
应收股利	-	-	-	-	-	861,942.35	861,942.35
应收申购款	1,674.87	-	-	-	-	1,956,598.06	1,958,272.93
资产总计	4,064,425,300.62	19,450,374.60	282,824,368.20	-	-	3,818,303,727.05	8,185,003,770.47
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,810,152.31	9,810,152.31
应付托管费	-	-	-	-	-	1,635,025.40	1,635,025.40
应交税费	-	-	-	-	-	21.95	21.95
其他负债	-	-	-	-	-	87,713.12	87,713.12
负债总计	-	-	-	-	-	11,532,912.78	11,532,912.78
利率敏感度缺口	4,064,425,300.62	19,450,374.60	282,824,368.20	-	-	3,806,770,814.27	8,173,470,857.69

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021年06月30日
	市场利率上升25个基点	-374,180.98
	市场利率下降25个基点	374,180.98

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	美元折	港币折合人民	其他币	合计

	合人民币	币	种折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	771,792,409.12	-	771,792,409.12
应收股利	-	861,942.35	-	861,942.35
资产合计	-	772,654,351.47	-	772,654,351.47
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	772,654,351.47	-	772,654,351.47

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021年06月30日
	所有外币相对人民币升值5%	38,632,717.57
	所有外币相对人民币贬值5%	-38,632,717.57

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	3,810,319,693.07	46.62
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	302,274,742.80	3.70
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	4,112,594,435.87	50.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021年06月30日
	业绩比较基准上升5%	191,659,914.62
	业绩比较基准下降5%	-191,659,914.62

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币3,780,857,936.59元，属于第二层次的余额为人民币302,274,742.80元，属于第三层次的余额为人民币29,461,756.48元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,810,319,693.07	46.55
	其中：股票	3,810,319,693.07	46.55
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	302,274,742.80	3.69
	其中：债券	302,274,742.80	3.69
	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	1,612,980,645.00	19.71
	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	2,451,523,625.75	29.95
8	其他各项资产	7,985,708.85	0.10
9	合计	8,185,084,415.47	100.00

注：权益投资中港股通股票公允价值为771,792,409.12元，占基金总资产比例9.43%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
C	制造业	2,046,539,702.78	25.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,660,970.26	0.82
E	建筑业	395,747,229.58	4.84
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	228,769,059.10	2.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	170,109,834.80	2.08
J	金融业	130,272,597.43	1.59
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	427,890.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	3,038,527,283.95	37.18

7.2.2 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	169,503,283.07	2.07

日常消费品	56,180,377.44	0.69
金融	103,773,689.28	1.27
医疗保健	116,633,818.51	1.43
信息技术	165,391,376.69	2.02
电信服务	160,309,864.13	1.96
合计	771,792,409.12	9.44

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	600438	通威股份	12,827,206	555,033,203.62	6.79
2	603098	森特股份	9,416,079	366,285,473.10	4.48
3	002311	海大集团	3,174,331	259,025,409.60	3.17
4	300207	欣旺达	6,931,528	225,690,551.68	2.76
5	600893	航发动力	4,120,217	219,154,342.23	2.68
6	H03690	美团-W	635,800	169,503,283.07	2.07
7	H01810	小米集团-W	7,361,800	165,391,376.69	2.02
8	H00700	腾讯控股	329,900	160,309,864.13	1.96
9	600115	中国东航	28,052,800	142,508,224.00	1.74
10	002050	三花智控	5,614,163	134,627,628.74	1.65
11	600036	招商银行	2,403,997	130,272,597.43	1.59
12	300433	蓝思科技	4,362,380	128,297,595.80	1.57
13	002223	鱼跃医疗	3,060,005	116,677,990.65	1.43
14	H01801	信达生物	1,548,000	116,633,818.51	1.43
15	603688	石英股份	4,642,868	109,107,398.00	1.33
16	600741	华域汽车	4,097,172	107,632,708.44	1.32
17	H06886	HTSC	10,940,000	103,773,689.28	1.27
18	002352	顺丰控股	1,274,163	86,260,835.10	1.06

19	688289	圣湘生物	866,524	86,175,811.80	1.05
20	688568	中科星图	1,335,268	85,457,152.00	1.05
21	600570	恒生电子	830,872	77,478,814.00	0.95
22	600276	恒瑞医药	1,014,120	68,929,736.40	0.84
23	002267	陕天然气	9,703,198	66,660,970.26	0.82
24	H00291	华润啤酒	968,000	56,180,377.44	0.69
25	600248	陕西建工	7,082,153	29,461,756.48	0.36
26	300775	三角防务	645,427	24,655,311.40	0.30
27	603063	禾望电气	696,400	11,518,456.00	0.14
28	600406	国电南瑞	308,160	7,161,638.40	0.09
29	600576	祥源文化	83,900	427,890.00	0.01
30	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
31	603171	N税友	637	12,230.40	0.00

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600438	通威股份	500,521,042.34	6.12
2	002311	海大集团	295,495,537.79	3.62
3	600893	航发动力	290,122,967.96	3.55
4	002352	顺丰控股	263,535,151.10	3.22
5	603098	森特股份	254,038,149.40	3.11
6	H01810	小米集团—W	251,674,037.19	3.08
7	300207	欣旺达	214,899,895.17	2.63
8	H03690	美团—W	201,089,630.78	2.46
9	H00700	腾讯控股	189,033,669.76	2.31

10	H01772	赣锋锂业	179,588,009.14	2.20
11	601012	隆基股份	174,402,069.47	2.13
12	600115	中国东航	169,627,765.48	2.08
13	002223	鱼跃医疗	165,572,573.30	2.03
14	H01801	信达生物	164,101,674.17	2.01
15	H00175	吉利汽车	145,013,559.75	1.77
16	300433	蓝思科技	143,834,026.73	1.76
17	002460	赣锋锂业	140,155,341.38	1.71
18	002050	三花智控	129,340,714.14	1.58
19	600741	华域汽车	127,141,573.88	1.56
20	H06886	HTSC	124,338,693.03	1.52

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	H01772	赣锋锂业	185,324,345.14	2.27
2	601012	隆基股份	181,872,127.14	2.23
3	002460	赣锋锂业	146,093,224.45	1.79
4	H00175	吉利汽车	136,628,679.41	1.67
5	002352	顺丰控股	114,656,517.18	1.40
6	000768	中航西飞	105,914,098.29	1.30
7	H09922	九毛九	101,798,841.73	1.25
8	H01810	小米集团—W	99,057,023.42	1.21
9	603650	彤程新材	90,033,671.16	1.10
10	002223	鱼跃医疗	88,106,098.99	1.08
11	000998	隆平高科	85,651,334.07	1.05
12	600893	航发动力	78,934,976.77	0.97
13	600089	特变电工	70,757,989.19	0.87
14	002311	海大集团	63,267,520.24	0.77

15	H01801	信达生物	57,039,574.35	0.70
16	300775	三角防务	39,803,012.24	0.49
17	H00291	华润啤酒	35,756,382.44	0.44
18	H03690	美团-W	33,973,640.83	0.42
19	600741	华域汽车	24,579,093.08	0.30
20	600104	上汽集团	22,715,110.00	0.28

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,389,727,319.12
卖出股票收入（成交）总额	1,834,512,060.71

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	282,824,368.20	3.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,450,374.60	0.24
	其中：政策性金融债	19,450,374.60	0.24
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	302,274,742.80	3.70

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					值比例 (%)
1	019649	21国债01	2,238,910	224,047,723.70	2.74
2	019645	20国债15	585,950	58,776,644.50	0.72
3	108604	国开1805	193,980	19,450,374.60	0.24

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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进行国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一天内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

美团-W：因违反《网络餐饮服务食品安全监督管理办法》第八条第一款及《中华人民共和国食品安全法》第一百三十一条第一款规定，北京市西城区市场监督管理局于2021-4-9依据相关法规给予：罚款70000元，没收违法所得164.4元处分决定。因构成违法实施的经营者集中，国家市场监督管理总局于2021-7-6依据相关法规给予：罚款50万元处分决定。腾讯控股：因价格垄断，国家市场监督管理总局于2021-3-12依据相关法规给予：罚款50万处分决定。因未依法履行职责，国家互联网信息办公室于2021-3-12依据相关法规给予：诫勉谈话，下达整改通知处分决定。因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-4-30依据相关法规给予：罚款50万处分决定。因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-4-30依据相关法规给予：罚款50万处分决定。因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-7-7依据相关法规给予：罚款50万处分决定。因涉嫌价格垄断，国家市场监管总局于2021-7-7依据相关法规给予：罚款50万处分决定。因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-7-7依据相关法规给予：罚款50万处分决定。因涉嫌违反法律法规，国家市场监管总局于2021-7-7依据相关法规给予：罚款50万处分决定。因违规经营，工业和信息化部于2021-7-8依据相关法规给予：责令改正处分决定。

7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	861,942.35
4	应收利息	5,165,493.57
5	应收申购款	1,958,272.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	7,985,708.85
---	----	--------------

7.12.4 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换债券。

7.12.5 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的情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
137,001	57,995.23	25,013,384.51	0.31%	7,920,391,372.54	99.69%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,380,433.88	0.13%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年03月01日)基金份额总额	7,908,730,992.68
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	36,673,764.37
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	7,945,404,757.05

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人

本报告期基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	7,198,881,718.42	100.00%	6,546,988.26	100.00%	-

基金管理人负责选择证券经纪机构，使用其专用的交易单元作为本基金的交易单元。基金管理人根据内部控制、合规状况、诚信状况、人员储备、业务隔离措施、软硬件设施、专业能力、程序状况等综合评定选择证券经纪机构。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	309,788,505.89	100.00%	28,583,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06
2	朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06
3	朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06
4	朱雀恒心一年持有期混合型	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06

	证券投资基金招募说明书		
5	朱雀恒心一年持有证券投资基金基金合同托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06
6	朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金提前结束募集公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
7	朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金募集期认购申请确认比例的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
8	朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-02
9	朱雀基金管理有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-28
10	朱雀恒心一年持有期混合型证券投资基金基金开发日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予朱雀恒心一年持有混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《朱雀恒心一年持有混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《朱雀恒心一年持有混合型证券投资基金托管协议》

- 4、《朱雀恒心一年持有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

12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人的办公场所

12.3 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
二〇二一年八月二十六日