

先锋日添利货币市场基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:先锋基金管理有限公司

基金托管人:渤海银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 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。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月28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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年6月30日。

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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 债券回购融资情况	46
7.3 基金投资组合平均剩余期限	46
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	48
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	48
7.9 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 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	50
§9 开放式基金份额变动	51

§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	53
10.9 其他重大事件.....	53
§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.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	先锋日添利货币市场基金	
基金简称	先锋日添利	
基金主代码	004151	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年04月14日	
基金管理人	先锋基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	54,821,102.47份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	先锋日添利A	先锋日添利B
下属分级基金的交易代码	004151	004152
报告期末下属分级基金的份额总额	44,341,818.32份	10,479,284.15份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济走势、货币政策、短期资金市场状况等因素对利率走势进行综合判断，并根据利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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		先锋基金管理有限公司	渤海银行股份有限公司
信息披露	姓名	黄劲松	阮劲松

露负责人	联系电话	400-815-9998	022-58316243
	电子邮箱	heguifengkong@xf-fund.com	js.ruan@cbhb.com.cn
客户服务电话		400-815-9998	4008888811/95541
传真		010-58239896	022-58314791
注册地址		深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室	天津市河东区海河东路218号
办公地址		深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室	天津市河东区海河东路218号
邮政编码		518046	300012
法定代表人		Wong Leah Kuen	李伏安

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xf-fund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	先锋基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室

§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
----------------------	-----

	(2023年01月01日-2023年06月30日)	
	先锋日添利A	先锋日添利B
本期已实现收益	393,574.76	102,826.55
本期利润	393,574.76	102,826.55
本期净值收益率	0.7324%	0.8025%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末基金资产净值	44,341,818.32	10,479,284.15
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
累计净值收益率	15.7787%	16.3361%

注：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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。本基金收益分配为按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

先锋日添利A

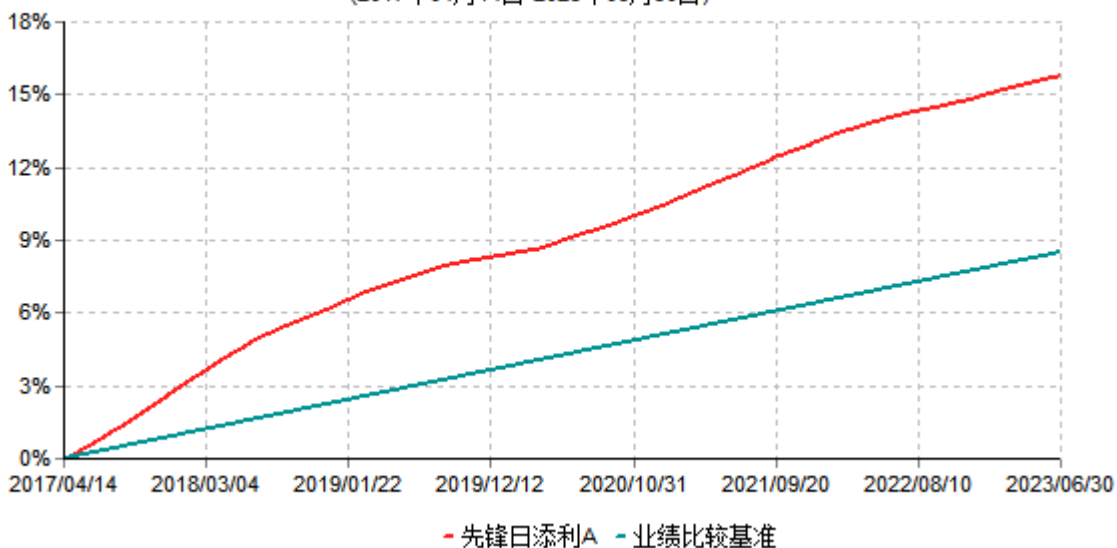
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.1108%	0.0001%	0.1125%	0.0000%	-0.0017%	0.0001%
过去三个月	0.3460%	0.0003%	0.3413%	0.0000%	0.0047%	0.0003%
过去六个月	0.7324%	0.0005%	0.6788%	0.0000%	0.0536%	0.0005%
过去一年	1.4224%	0.0006%	1.3688%	0.0000%	0.0536%	0.0006%
过去三年	6.0038%	0.0034%	4.1063%	0.0000%	1.8975%	0.0034%
自基金合同 生效起至今	15.7787%	0.0036%	8.5088%	0.0000%	7.2699%	0.0036%

先锋日添利B

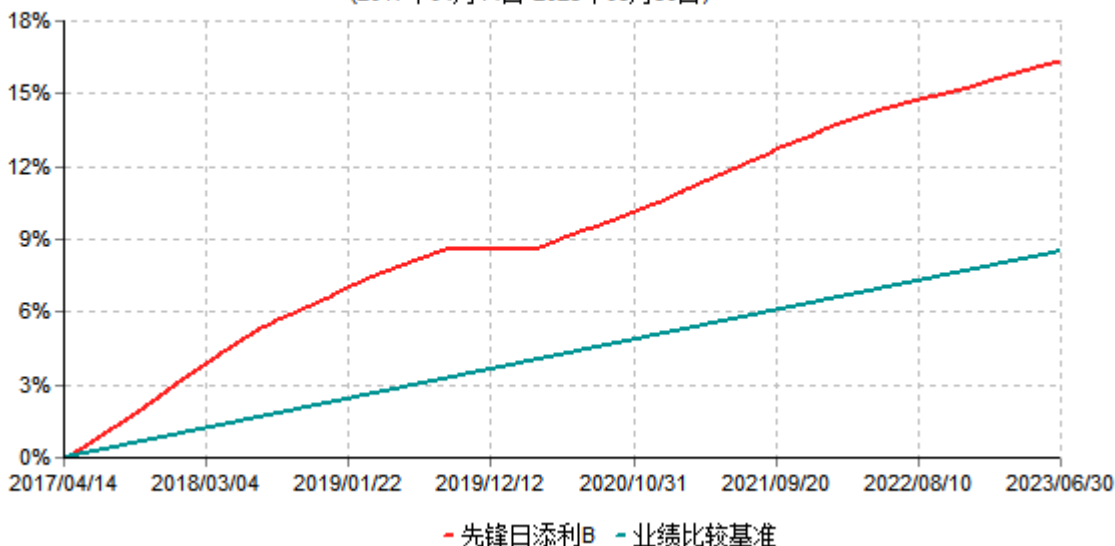
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.1223%	0.0001%	0.1125%	0.0000%	0.0098%	0.0001%
过去三个月	0.3811%	0.0003%	0.3413%	0.0000%	0.0398%	0.0003%
过去六个月	0.8025%	0.0005%	0.6788%	0.0000%	0.1237%	0.0005%
过去一年	1.5647%	0.0006%	1.3688%	0.0000%	0.1959%	0.0006%
过去三年	6.4385%	0.0034%	4.1063%	0.0000%	2.3322%	0.0034%
自基金合同 生效起至今	16.3361%	0.0040%	8.5088%	0.0000%	7.8273%	0.0040%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

先锋日添利A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年04月14日-2023年06月30日)



先锋日添利B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年04月14日-2023年06月30日)



注：1：本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

2：2022年3月8日B类基金份额为零且停止计算B类基金份额净值和基金份额累计净值。

§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

先锋基金管理有限公司(以下简称"先锋基金")于2016年4月19日经中国证监会批准,2016年5月16日注册成立,截至报告期末,注册资本为1.55亿元人民币。其中,联合创业集团有限公司占注册资本的33.1041%,大连亚联投资管理有限公司占注册资本的33.1039%,北京鹏康投资有限公司占注册资本的21.7790%,张松孝占注册资本的4.9904%,深圳大华信安私募证券投资基金管理企业(有限合伙)占注册资本的4.8290%,深圳市瑞智源投资合伙企业(有限合伙)占注册资本的2.1936%。截至报告期末,先锋基金旗下管理先锋现金宝货币市场基金、先锋精一灵活配置混合型发起式证券投资基金、先锋聚元灵活配置混合型证券投资基金、先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金、先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金、先锋日添利货币市场基金、先锋汇盈纯债债券型证券投资基金、先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金及先锋博盈纯债债券型证券投资基金9只开放式基金。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜旭	投资管理部总监、基金经理	2020-02-24	-	13年	金融学硕士，1987年2月生，2010年毕业于中南财经政法大学，现任公司投资管理部固收总监、基金经理。2010年至2019年先后任第一创业证券固定收益部交易员，华润信托债券投资经理、融通资本固定收益高级投资经理，2019年8月加入先锋基金从事投资研究工作。
黄意球	基金经理	2022-07-18	-	7年	中国科学院博士，曾任大公国际资信评估有限公司信用分析师、吉祥人寿保险股份有限公司信用评估经理、平安基金管理有限公司固定收益研究员。2021年5月加入先锋基金管理有限公司任基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规及基金合同的约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《先锋基金管理有限公司公平交易制度》等相关规定，公司建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合及所有投资管理活动，贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等各环节，并通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与本公司管理的其他投资组合之间有导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，未出现本公司管理的投资组合参与交易所公开竞价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5%的交易。

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

2023年上半年，国内经济经历了疫情后的需求释放、复苏节奏放缓两个阶段，整体经济内生动力仍显不足，货币政策再次释放宽松信号。一季度，地产政策继续放松，叠加疫情后的需求释放，地产销售有所好转，但二季度开始销售转弱，投融资下滑压力仍然较大。企业盈利下滑幅度在二季度开始收窄，但仍处于去库存阶段，工业生产偏弱，加之出口增速下滑，制造业投资增速延续下行。基建投资增速保持高位，部分对冲了整体固定资产投资增速的下行压力。消费方面，社消零售当月同比两年复合增速较低，居民收入预期悲观条件下，消费复苏缓慢。海外方面，美联储6月暂停加息，表明加息节奏放缓，但美国劳动力市场较好、消费仍有韧性，利率可能较长时间保持高位，出口下滑压力延续。物价方面，国内PPI仍处于通缩区间，但已在底部区域；猪肉供给充足，猪价低迷，CPI维持低位，国内不存在大幅通胀或通缩的基础。货币政策方面，年初贷款大幅投放，超储消耗较多，资金利率回到政策利率水平。二季度，新增贷款增速放缓，流动性充裕，资金成本有所下行。6月，央行引导OMO/MLF/LPR同步下调10BP，资金利率中枢下移。年初随着信贷大幅投放，社融与M2增速上行，二季度经济复苏节奏放缓，M2与社融增速先后回落。市场方面，一季度资金中枢回归政策利率水平，短端利率维持震荡；二季度资金成本逐步下行，短端利率也随之下行。同业存单收益率年初受资金成本影响维持震荡，二季度资金成本下行，1年期AAA同业存单下行至2.25%的低点，并在6月末有所反弹。

报告期内，本基金结合负债端情况，在保证组合流动性的前提下，以利率债、存单、逆回购为主进行交易和配置操作，整体实现了较为稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末先锋日添利A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.7324%，同期业绩比较基准收益率为0.6788%；截至报告期末先锋日添利B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.8025%，同期业绩比较基准收益率为0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为货币政策仍会以稳经济、结构性政策为主，加强逆周期调节，助力经济增速企稳。流动性方面，央行将保持流动性合理充裕，资金面偏松，资金利率可能在政策利率下方附近波动。我们将继续稳健操作，力争在保障安全性、流动性的情况下，为客户创造良好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了先锋基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会的职责主要包括有：制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》规定及本基金合同约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日支付。

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

本基金本报告期未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期内，渤海银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对先锋日添利货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：先锋日添利货币市场基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	55,092.07	106,378.98
结算备付金		4,452,011.50	4,402,340.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	50,457,347.52	50,246,580.56

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		50,457,347.52	50,246,580.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	25,030,889.80
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,628.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		54,971,079.09	79,786,189.34
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,854.23	10,257.08

应付托管费		2,284.76	3,419.02
应付销售服务费		5,649.18	8,213.89
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		2,090.21	4,769.95
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	133,098.24	176,720.83
负债合计		149,976.62	203,380.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	54,821,102.47	79,582,808.57
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	-	-
净资产合计		54,821,102.47	79,582,808.57
负债和净资产总计		54,971,079.09	79,786,189.34

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额为54,821,102.47份，其中A类基金份额净值1.0000元，基金份额总额为44,341,818.32份；B类基金份额净值1.0000元，基金份额总额为10,479,284.15份。

6.2 利润表

会计主体：先锋日添利货币市场基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		658,792.76	1,672,343.91
1.利息收入		212,065.20	456,244.76
其中：存款利息收入	6.4.7.8	45,586.29	45,805.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产		166,478.91	410,439.17

收入			
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		446,727.56	1,216,097.78
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	446,727.56	1,216,097.78
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.11	-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.14	-	-
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）		-	1.37
减：二、营业总支出		162,391.45	301,728.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	49,340.54	108,698.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,446.85	36,232.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	40,493.85	85,034.36
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,743.26	9,064.58
其中：卖出回购金融资产 支出		1,743.26	9,064.58
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-

8. 其他费用	6.4.7.15	54,366.95	62,698.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		496,401.31	1,370,615.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		496,401.31	1,370,615.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		496,401.31	1,370,615.17

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：先锋日添利货币市场基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	79,582,808.57	-	-	79,582,808.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	79,582,808.57	-	-	79,582,808.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,761,706.10	-	-	-24,761,706.10
（一）、综合收益总额	-	-	496,401.31	496,401.31

(二)、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)	-24,761,706.10	-	-	-24,761,706.10
其中: 1.基金申购款	11,092,652.23	-	-	11,092,652.23
2.基金赎回款	-35,854,358.33	-	-	-35,854,358.33
(三)、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)	-	-	-496,401.31	-496,401.31
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	54,821,102.47	-	-	54,821,102.47
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	175,868,571.90	-	-	175,868,571.90
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产（基金净值）	175,868,571.90	-	-	175,868,571.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-70,664,903.87	-	-	-70,664,903.87
（一）、综合收益总额	-	-	1,370,615.17	1,370,615.17
（二）、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）	-70,664,903.87	-	-	-70,664,903.87
其中：1.基金申购款	328,907,703.15	-	-	328,907,703.15
2.基金赎回款	-399,572,607.02	-	-	-399,572,607.02
（三）、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）	-	-	-1,370,615.17	-1,370,615.17
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	105,203,668.03	-	-	105,203,668.03

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：

龙涌

吴越

谢玲玉

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

先锋日添利货币市场基金(以下简称本基金或基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)《关于准予先锋日添利货币市场基金注册的批复》(证监许可〔2016〕3072号)核准,由先锋基金管理有限公司(以下简称先锋基金公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》《先锋日添利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金类型为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集391,236,112.26元,设立时募集资金到位情况业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并由其出具《验资报告》(普华永道中天验字〔2017〕第388号)。经向中国证监会备案,《先锋日添利货币市场基金基金合同》于2017年4月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为391,246,786.05份,其中认购资金利息折合10,673.79份基金份额。本基金的管理人为先锋基金有限责任公司,基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据《先锋日添利货币市场基金基金合同》和《先锋日添利货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金根据基金份额持有人持有本基金的份额数量进行基金份额类别划分。本基金将设A类和B类两类基金份额,两类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,两类基金份额单独设置基金代码,并单独公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《先锋日添利货币市场基金基金合同》的规定,本基金投资范围为:法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据和同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本财务报表由本基金的基金管理人先锋基金管理有限公司于2023年8月30日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和财政部《资产管理产品相关会计处理规定》(财会〔2022〕14号)、中国证券投资基金业协会(以下简称中国基金业协会)《证券投资基金

会计核算业务指引》的要求，并按照中国证监会2022年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》编制，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

1) 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制

和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

2. 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指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。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

1. 新金融工具准则

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,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;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

2. 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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，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；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证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。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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有

在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金：(1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的A、B类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

1. 新金融工具准则

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

2. 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.9 费用的确认和计量

1. 新金融工具准则

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

2. 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每日以红利再投资方式进行支付。

6.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	
	2023年06月30日	
活期存款		55,092.07
等于：本金		55,077.93
加：应计利息		14.14
减：坏账准备		-
定期存款		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
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		-
等于：本金		-
加：应计利息		-
减：坏账准备		-
合计		55,092.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2023年06月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	50,457,347.52	50,456,657.53	-689.99	-0.0013
	合计	50,457,347.52	50,456,657.53	-689.99	-0.0013
资产支持证券		-	-	-	-
合计		50,457,347.52	50,456,657.53	-689.99	-0.0013

注：

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值X100%。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	3,331.29
其中：交易所市场	-
银行间市场	3,331.29
应付利息	-
预提费用	129,766.95
合计	133,098.24

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 先锋日添利A

金额单位：人民币元

项目 (先锋日添利A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	62,383,928.76	62,383,928.76
本期申购	5,692,143.20	5,692,143.20
本期赎回（以“-”号填列）	-23,734,253.64	-23,734,253.64
本期末	44,341,818.32	44,341,818.32

6.4.7.6.2 先锋日添利B

金额单位：人民币元

项目 (先锋日添利B)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,198,879.81	17,198,879.81
本期申购	5,400,509.03	5,400,509.03
本期赎回（以“-”号填列）	-12,120,104.69	-12,120,104.69
本期末	10,479,284.15	10,479,284.15

注：

申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含级别调整、转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 先锋日添利A

单位：人民币元

项目 (先锋日添利A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	393,574.76	-	393,574.76
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-393,574.76	-	-393,574.76
本期末	-	-	-

6.4.7.7.2 先锋日添利B

单位：人民币元

项目 (先锋日添利B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	102,826.55	-	102,826.55
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-102,826.55	-	-102,826.55
本期末	-	-	-

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	386.04
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	45,200.25
其他	-
合计	45,586.29

[注]其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
----	-------------------------------

债券投资收益——利息收入	445,604.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,123.18
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	446,727.56

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	50,305,729.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,010,081.82
减：应计利息总额	294,524.46
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,123.18

6.4.7.11 贵金属投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.13 股利收益

无。

6.4.7.14 公允价值变动收益

无。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	13,151.46
帐户维护费	18,900.00
合计	54,366.95

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2023年6月30日，本基金不存在应披露未披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金不存在应披露未披露的重大承诺事项。

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
先锋基金管理有限公司（“先锋基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
渤海银行股份有限公司（“渤海银行”）	基金托管人
联合创业集团有限公司	基金管理人股东
大连亚联投资管理有限公司	基金管理人股东
北京鹏康投资有限公司	基金管理人股东
张松孝	基金管理人股东

深圳大华信安私募证券基金管理企业（有限合伙）	基金管理人股东
深圳市瑞智源投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	49,340.54	108,698.68
其中：支付销售机构的客户维护费	15,967.66	38,729.96

注1：支付基金管理人的管理人报酬年费率为0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数

注2：根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售

基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,446.85	36,232.94

注：支付基金托管人渤海银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	先锋日添利A	先锋日添利B	合计
先锋基金	93.59	622.83	716.42
渤海银行	0.00	0.00	0.00
合计	93.59	622.83	716.42
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	先锋日添利A	先锋日添利B	合计
先锋基金	784.98	415.32	1,200.30
渤海银行	0.00	0.00	0.00
合计	784.98	415.32	1,200.30

注：支付基金销售机构的销售服务费A类按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，B类按前一日基金资产净值0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给先锋基金，再由先锋基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

A类日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.15%/ 当年天数。

B类日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.01%/ 当年天数。

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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

先锋日添利A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

先锋日添利B

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	12,185,324.07	0.00
报告期间申购/买入总份额	93,960.08	12,732,729.23
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,800,000.00	5,011,611.84
报告期末持有的基金份额	10,479,284.15	7,721,117.39
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	100.00%	43.44%

注：

- 1.期间申购含红利再投份额。
- 2.基金管理人先锋基金管理有限公司在上年度申购/赎回本基金的交易委托先锋基金直销中心办理，本基金不收取申购/赎回费用。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

先锋日添利A

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
张松孝	692.95	0.0016%	687.63	0.0011%

6.4.10.5 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渤海银行股份有限公司	55,092.07	386.04	81,109.85	1,779.39

注：本基金的银行存款由基金托管人渤海银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

先锋日添利A

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
395,604.02	-	-2,029.26	393,574.76	-

先锋日添利B

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
103,477.03	-	-650.48	102,826.55	-

注：本基金在本半年度累计分配收益496,401.31元，其中以红利再投资方式结转入实收基金499,081.05元，计入应付收益科目-2,679.74元。

6.4.12 期末（2023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
无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
无。

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
无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购
无。

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

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险，并设定适当的投资限额，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成：第一层次为董事会、风险控制委

员会所领导；第二层次为总经理、督察长、风险管理委员会、监察稽核部所监控；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行渤海银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于2023年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0%（2022年12月31日：0%）。

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	20,492,278.44	50,246,580.56
合计	20,492,278.44	50,246,580.56

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

2、未评级部分为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	29,965,069.08	-
合计	29,965,069.08	-

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或于约定开放日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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还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，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过60天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%。于2023年6月30日，本基金前10名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为10.93%，本基金投资组合的平均剩余期限为21天，平均剩余存续期为21天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。于2023年6月30日，本基金无流动性受限资产。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	55,092.07	-	-	-	-	55,092.07
结算备付金	4,452,011.50	-	-	-	-	4,452,011.50
交易性金融资产	50,457,347.52	-	-	-	-	50,457,347.52
应收申购款	-	-	-	-	6,628.00	6,628.00
资产总计	54,964,451.09	-	-	-	6,628.00	54,971,079.09
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	6,854.23	6,854.23
应付托管费	-	-	-	-	2,284.76	2,284.76
应付销售服务费	-	-	-	-	5,649.18	5,649.18
应付利润	-	-	-	-	2,090.21	2,090.21

其他负债	-	-	-	-	133,098.24	133,098.24
负债总计	-	-	-	-	149,976.62	149,976.62
利率敏感度缺口	54,964,451.09	-	-	-	-143,348.62	54,821,102.47
上年度末 2022年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	106,378.98	-	-	-	-	106,378.98
结算备付金	4,402,340.00	-	-	-	-	4,402,340.00
交易性金融资产	50,246,580.56	-	-	-	-	50,246,580.56
买入返售金融资产	25,030,889.80	-	-	-	-	25,030,889.80
资产总计	79,786,189.34	-	-	-	-	79,786,189.34
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	10,257.08	10,257.08
应付托管费	-	-	-	-	3,419.02	3,419.02
应付销售服务费	-	-	-	-	8,213.89	8,213.89
应付利润	-	-	-	-	4,769.95	4,769.95
其他负债	-	-	-	-	176,720.83	176,720.83
负债总计	-	-	-	-	203,380.77	203,380.77
利率敏感度缺口	79,786,189.34	-	-	-	-203,380.77	79,582,808.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
----	---

假设	假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化。		
假设	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	8,009.42	23,597.83
	2.市场利率上升25个基点	-8,005.83	-23,572.06

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-

第二层次	50,457,347.52	50,246,580.56
第三层次	-	-
合计	50,457,347.52	50,246,580.56

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	固定收益投资	50,457,347.52	91.79
	其中：债券	50,457,347.52	91.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

3	银行存款和结算备付金合计	4,507,103.57	8.20
4	其他各项资产	6,628.00	0.01
5	合计	54,971,079.09	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.13	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	21
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	68
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	2

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限没有超过120天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	82.07	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	18.19	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.26	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期没有超过240天的情况。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,492,278.44	37.38
	其中：政策性金融债	20,492,278.44	37.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	29,965,069.08	54.66
8	其他	-	-

9	合计	50,457,347.52	92.04
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	092118003	21农发清发03	200,000	20,492,278.44	37.38
2	112206170	22交通银行C D170	100,000	9,998,266.71	18.24
3	112319124	23恒丰银行C D124	100,000	9,993,678.02	18.23
4	112214133	22江苏银行C D133	100,000	9,973,124.35	18.19

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0142%
报告期内偏离度的最低值	-0.1146%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0298%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持1.00元。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，未出现在报告编制日前一年内受到银保监会处罚的情形。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.9.3 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	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	6,628.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,628.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

份额 级别	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

先锋日添利A	6,563	6,756.33	420,089.36	0.95%	43,921,728.96	99.05%
先锋日添利B	1	10,479,284.15	10,479,284.15	100.00%	0.00	0.00%
合计	6,564	8,351.78	10,899,373.51	19.88%	43,921,728.96	80.12%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	个人	1,024,134.17	1.8681%
2	个人	911,466.34	1.6626%
3	个人	718,207.93	1.3101%
4	个人	670,797.33	1.2236%
5	个人	502,098.01	0.9159%
6	个人	459,503.69	0.8382%
7	个人	456,664.86	0.833%
8	个人	426,890.17	0.7787%
9	个人	417,794.33	0.7621%
10	个人	406,498.75	0.7415%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	先锋日添利A	884.08	0.0020%
	先锋日添利B	0.00	0.00%
	合计	884.08	0.0016%

8.4 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	份额级别	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	先锋日添利A	0
	先锋日添利B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	先锋日添利A	0
	先锋日添利B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	先锋日添利A	先锋日添利B
基金合同生效日(2017年04月14 日)基金份额总额	230,239,341.61	161,007,444.44
本报告期期初基金份额总额	62,383,928.76	17,198,879.81
本报告期基金总申购份额	5,692,143.20	5,400,509.03
减：本报告期基金总赎回份额	23,734,253.64	12,120,104.69
本报告期期末基金份额总额	44,341,818.32	10,479,284.15

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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

本基金管理人本报告期内重大人事变动：

高级管理人员变动：根据我公司第二届董事会第八次临时会议决议，同意刘冬先生离任公司首席信息官；根据我公司第二届董事会第九次临时会议决议，同意高明达先生离任公司常务副总经理。

本报告期内托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况如下：

本报告期内，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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内无对基金托管业务产生重大影响的重大诉讼和仲裁事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

因业务开展需要，经本公司第二届董事会第三次临时会议审议通过并经全体独立董事同意，本基金自2023年1月10日起，改聘天健会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，上述改聘事宜已通知基金托管人或经基金托管人同意。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
万联证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，

具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在0.5%（含）以上的情况。

10.9 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	先锋基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-11
2	关于先锋日添利货币市场基金2023年“春节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-18
3	先锋日添利货币市场基金2022年第四季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-19
4	先锋基金管理有限公司关于董事长（法定代表人）变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-20
5	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-20
6	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-20
7	先锋基金管理有限公司关于	上海证券报、中国证券报、	2023-03-21

	北京办公地址变更的公告	证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	
8	先锋日添利货币市场基金招募说明书（更新）（2023年第1号）	证券时报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-03-23
9	先锋日添利货币市场基金基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-03-23
10	先锋日添利货币市场基金2022年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-03-31
11	先锋日添利货币市场基金2023年第1季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-04-21
12	关于先锋日添利货币市场基金2023年“五一”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-04-26
13	关于先锋基金管理有限公司董事、监事变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-05-08
14	先锋基金管理有限公司关于终止吉林九台农村商业银行股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-05-16
15	先锋基金管理有限公司2023年基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-05-23
16	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-05-30
17	关于先锋日添利货币市场基	证券时报、基金管理人网站、	2023-06-17

	金2023年“端午”假期前暂停代销渠道申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证监会指定网站	
--	--	---------	--

§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

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2023年1月11日，基金管理人在中国证监会规定媒体及规定网站刊登了《先锋基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所的公告》，具体内容详见公告。

2023年5月8日，基金管理人在中国证监会规定媒体及规定网站刊登了《关于先锋基金管理有限公司董事、监事变更的公告》，具体内容详见公告。

2023年5月23日、5月30日，基金管理人在中国证监会规定媒体及规定网站刊登了《关于高级管理人员变更的公告》，具体内容详见公告。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证券监督管理委员会批准先锋日添利货币市场基金设立的文件
- 12.1.2 《先锋日添利货币市场基金基金合同》
- 12.1.3 《先锋日添利货币市场基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 报告期内先锋日添利货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人先锋基金管理有限公司

官方网站：<http://www.xf-fund.com>

先锋基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日