

先锋日添利货币市场基金

2025 年中期报告

2025 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:2025 年 08 月 29 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2025年8月25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2025年01月01日起至2025年06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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
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	13
§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 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 债券回购融资情况	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限	37
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	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	39
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	39
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	39
7.9 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§9 开放式基金份额变动	42

§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	44
10.9 其他重大事件	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§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	48,573,353.22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	28,562,943.18份	20,010,410.04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

信息披露负责人	姓名	王重昆	丁晓光
	联系电话	010-58239806	022-58314940
	电子邮箱	service@xf-fund.com	xg.ding@cbhb.com.cn
客户服务电话		400-815-9998	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		王重昆	王锦虹

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 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	先锋日添利A	先锋日添利B
本期已实现收益	211,082.35	12,225.91
本期利润	211,082.35	12,225.91
本期净值收益率	0.7246%	0.0662%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末基金资产净值	28,562,943.18	20,010,410.04
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 (2025年06月30日)	
累计净值收益率	19.3285%	17.6698%

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，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。

2.本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

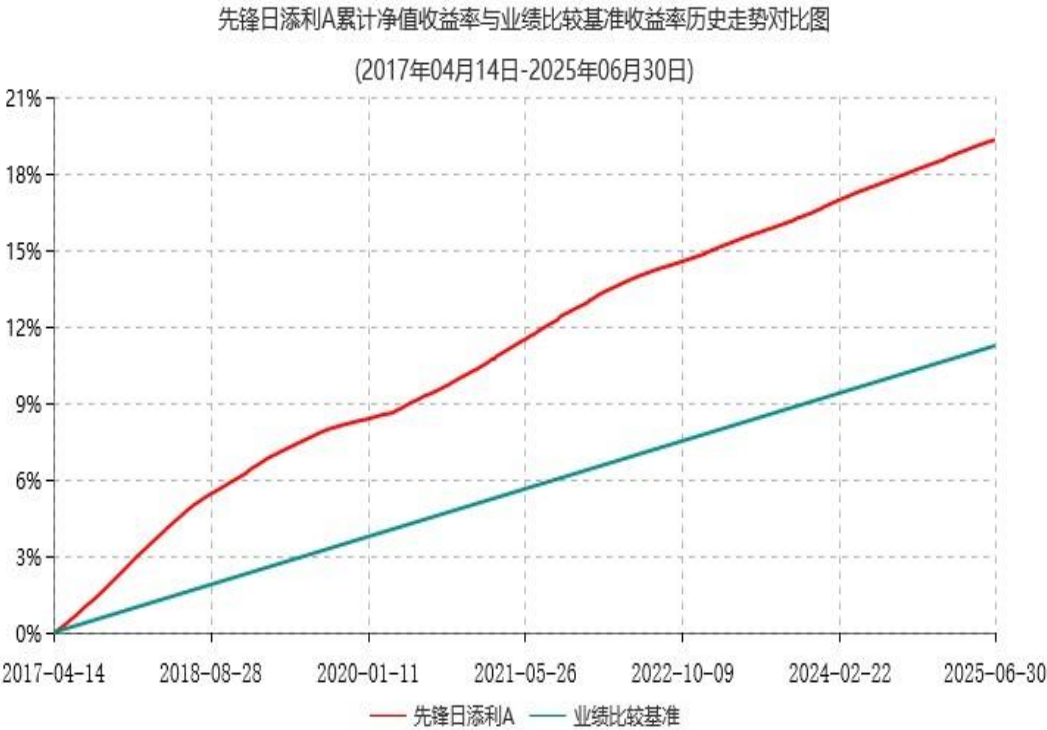
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.1013%	0.0008%	0.1125%	0.0000%	-0.0112%	0.0008%
过去三个月	0.3380%	0.0012%	0.3413%	0.0000%	-0.0033%	0.0012%
过去六个月	0.7246%	0.0016%	0.6788%	0.0000%	0.0458%	0.0016%
过去一年	1.4654%	0.0011%	1.3688%	0.0000%	0.0966%	0.0011%
过去三年	4.5320%	0.0009%	4.1100%	0.0000%	0.4220%	0.0009%
自基金合同	19.3285%	0.0033%	11.2500%	0.0000%	8.0785%	0.0033%

生效起至今						
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	0.0662%	0.0018%	0.1125%	0.0000%	-0.0463%	0.0018%
过去三个月	0.0662%	0.0015%	0.3413%	0.0000%	-0.2751%	0.0015%
过去六个月	0.0662%	0.0011%	0.6788%	0.0000%	-0.6126%	0.0011%
过去一年	0.5136%	0.0020%	1.3688%	0.0000%	-0.8552%	0.0020%
过去三年	2.7291%	0.0022%	4.1100%	0.0000%	-1.3809%	0.0022%
自基金合同 生效起至今	17.6698%	0.0043%	11.2500%	0.0000%	6.4198%	0.0043%

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





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：本报告期初至2025年6月12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2.05亿元人民币。其中,北京指南针科技发展股份有限公司占注册资本的93.4732%,北京福中达投资有限公司占注册资本的4.8683%,深圳市瑞智源投资合伙企业(有限合伙)占注册资本的1.6585%。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	基金经理	2020-02-24	-	15年	硕士，2019年8月加入先锋基金管理有限公司，从事投资研究工作，历任投资管理部基金经理助理、投资管理部总监及固收总监，现任投资管理部基金经理。曾先后任职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。现任先锋日添利货币市场基金基金经理、先锋现金宝货币市场基金基金经理、先锋博盈纯债债券型证券投资基金基金经理、先锋汇盈纯债债券型证券投资基金基金经理。
黄意球	基金经理	2022-07-18	-	9年	博士，2021年5月加入先锋基金管理有限公司，从事投资研究工作，历任投资管理部基金经理助理，现任投资管理部基金经理。曾先后任职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。现任先锋日添利货币市场基金基金经理、先锋现金宝货币

					市场基金基金经理、先锋博盈纯债债券型证券投资基金基金经理、先锋汇盈纯债债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从《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》等相关规定。

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，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及本基金的《基金合同》等基金法规文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责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，本基金运作合法合规，没有损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

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，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，公平对待旗下管理的所有投资组合。

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

2025年上半年，国内经济经历关税事件冲击，政策支持下经济韧性较强。一季度，商品房销售好转，专项债扩大使用范围、设备更新等政策支持下，基建、制造业投资保持高位，以旧换新拉动消费增长，GDP实际增速5.4%。4月上旬，美国对包括中国在内的众多国家加征高额关税，中国迅速反制，采取加征对等关税、实施稀土出口管制等措施。为稳定国内经济和金融市场，政策也积极应对，财政部加快专项债发行，央行5月

上旬降准降息，并增加科技创新等各类再贷款额度，支持汇金公司等大型机构投资股市，财政与货币政策协同发力。二季度，制造业PMI经历4月大幅下跌之后逐步反弹，工业增加值、消费仍然保持较高增速，出口保持较强韧性，投资增速略下行，当季GDP实际增速5.2%。由于总需求仍偏弱，不足以支撑物价上涨，物价增速仍保持低位。

市场方面，一季度，资金成本持续高于政策利率，叠加基本面有所改善，存单收益率持续上行。3月中旬，1年股份行存单收益率上行超过2.0%，较年初低点上行近50BP；二季度，美元指数大幅下行，人民币贬值压力缓解。资金成本持续下降，DR007从一季度1.9%左右下行至1.5%左右。叠加关税事件等因素影响，收益率再次下行，截至6月末股份行1年存单收益率约为1.64%。

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，配置了部分短期限利率债、逆回购，并根据市场情况及时止盈部分利率债，整体实现了稳健收益。

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1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.7246%，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1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.0662%，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，我们认为货币政策适度宽松，央行仍可能采取降准降息等措施。流动性方面，央行将保持流动性合理充裕，资金利率围绕政策利率波动。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《公开募集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。

本基金本报告期内向先锋日添利A类份额持有人分配利润211,082.35元；向先锋日添利B类份额持有人分配利润12,225.91元。

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

本报告期内，本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于5000万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

本报告期内，本基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

§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“本基金托管人”）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》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何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真实、准确和完整发表意见

本基金托管人对本报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	26,062,156.10	1,540,536.08
结算备付金		339,833.26	16,262,754.45
存出保证金		23,384.59	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,952,788.42	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,952,788.42	-
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	19,206,681.01	11,000,641.92
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		500.00	34,653.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		48,585,343.38	28,838,585.45
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024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		4,868.45	3,760.91
应付托管费		1,622.81	1,253.64
应付销售服务费		3,679.13	3,760.91
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		1,819.77	1,209.22
递延所得税负债		-	-
其他负债		-	-
负债合计		11,990.16	9,984.68
净资产：			
实收基金	6.4.7.5	48,573,353.22	28,828,600.77
未分配利润	6.4.7.6	-	-
净资产合计		48,573,353.22	28,828,600.77
负债和净资产总计		48,585,343.38	28,838,585.45

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额总额为48,573,353.22份，其中A类基金份额净值1.0000元，基金份额为28,562,943.18份；B类基金份额净值1.0000元，基金份额为20,010,410.04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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		275,877.13	418,996.86
1.利息收入		223,785.72	300,594.09
其中：存款利息收入	6.4.7.7	110,001.46	137,695.35

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		113,784.26	162,898.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		51,896.77	118,402.77
其中：股票投资收益	6.4.7.8	-	-
基金投资收益	6.4.7.9	-	-
债券投资收益	6.4.7.10	51,896.77	118,402.77
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.11	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	194.64	-
减：二、营业总支出		52,568.87	91,915.45
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	23,039.25	30,751.34
2.托管费	6.4.10.2.2	7,679.69	10,250.43
3.销售服务费	6.4.10.2.3	21,849.93	27,341.44
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-

7.税金及附加		-	-
8.其他费用		-	23,572.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		223,308.26	327,081.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		223,308.26	327,081.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		223,308.26	327,081.41

6.3 净资产变动表

会计主体：先锋日添利货币市场基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	28,828,600.77	-	28,828,600.77
二、本期期初净资产	28,828,600.77	-	28,828,600.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	19,744,752.45	-	19,744,752.45
（一）、综合收益总额	-	223,308.26	223,308.26
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	19,744,752.45	-	19,744,752.45

其中：1.基金申购款	33,459,255.82	-	33,459,255.82
2.基金赎回款	-13,714,503.37	-	-13,714,503.37
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-223,308.26	-223,308.26
四、本期期末净资产	48,573,353.22	-	48,573,353.22
项 目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	37,346,717.81	-	37,346,717.81
二、本期期初净资产	37,346,717.81	-	37,346,717.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	44,348,366.68	-	44,348,366.68
（一）、综合收益总额	-	327,081.41	327,081.41
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	44,348,366.68	-	44,348,366.68
其中：1.基金申购款	77,012,639.19	-	77,012,639.19
2.基金赎回款	-32,664,272.51	-	-32,664,272.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产	-	-327,081.41	-327,081.41

变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	81,695,084.49	-	81,695,084.49

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：

张帆	张帆	杜科
-----	-----	-----
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公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司(以下简称渤海银行)。

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公司于2025年8月28日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称"企业会计准则")、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。

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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。

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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1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》(财税〔2012〕85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〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36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〕46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〕70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〔2016〕140号)、

《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税〔2017〕2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90号）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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	26,062,156.10
等于：本金	26,051,168.97
加：应计利息	10,987.13
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	26,062,156.10

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025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	2,952,788.42	2,953,651.34	862.92	0.0018
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,952,788.42	2,953,651.34	862.92	0.0018
资产支持证券		-	-	-	-
合计		2,952,788.42	2,953,651.34	862.92	0.0018

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	19,206,681.01	-
银行间市场	-	-
合计	19,206,681.01	-

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 实收基金

6.4.7.5.1 先锋日添利A

金额单位：人民币元

项目 (先锋日添利A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,828,600.77	28,828,600.77
本期申购	8,399,991.72	8,399,991.72
本期赎回（以“-”号填列）	-8,665,649.31	-8,665,649.31
本期末	28,562,943.18	28,562,943.18

6.4.7.5.2 先锋日添利B

金额单位：人民币元

项目 (先锋日添利B)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	25,059,264.10	25,059,264.10
本期赎回（以“-”号填列）	-5,048,854.06	-5,048,854.06
本期末	20,010,410.04	20,010,410.04

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含级别调整、转换出份额

6.4.7.6 未分配利润

6.4.7.6.1 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
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	211,082.35	-	211,082.35
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	-211,082.35	-	-211,082.35
本期末	-	-	-

6.4.7.6.2 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
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	12,225.91	-	12,225.91
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	-12,225.91	-	-12,225.91
本期末	-	-	-

6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	109,321.99
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	663.66
其他	15.81
合计	110,001.46

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

6.4.7.8 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.9 基金投资收益

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 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	34,487.80
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,408.97
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	51,896.77

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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	76,273,934.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑	75,311,349.03

付) 成本总额	
减: 应计利息总额	945,176.95
减: 交易费用	-
买卖债券差价收入	17,408.97

6.4.7.11 股利收益

无。

6.4.7.12 公允价值变动收益

无。

6.4.7.13 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	-
其他	194.64
合计	194.64

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2025年6月30日, 本基金不存在应披露未披露的或有事项。

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

根据先锋基金管理有限公司2025年5月28日在公司官网披露的信息, 先锋基金股权结构变更为, 北京指南针科技发展股份有限公司(出资比例93.4732%)、北京福中达投资有限公司(出资比例4.8683%)、深圳市瑞智源投资合伙企业(有限合伙)(出资比例1.6585%)。

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

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 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 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,039.25	30,751.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,749.21	10,817.24
应支付基金管理人的净管理费	14,290.04	19,934.10

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 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,679.69	10,250.43

注：支付基金托管人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。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 2025年01月01日至2025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	77.80	76.92	154.72
合计	77.80	76.92	154.72
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	99.22	225.93	325.15
合计	99.22	225.93	325.15

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×0.15%÷当年天数。

B类日销售服务费=前一日基金资产净值×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

无。

6.4.10.4 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

无。

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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	26,062,156.10	109,321.99	57,384,070.19	135,457.60

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

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

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
211,266.61	-	-184.26	211,082.35	-

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
11,431.10	-	794.81	12,225.91	-

注：本基金在本年度累计分配收益223,308.26元，其中以红利再投资方式结转入实收基金222,697.71元，计入应付收益科目610.55元。

6.4.12 期末（2025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

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金在日常运营中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险和市场风险。本基金管理人制定了风险管理政策和风险控制程序来识别及分析这些风险，设定适当的投资限额和内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控和评估上述各类风险，并通过相应决策将风险控制在限定的范围之内。

本基金的基金管理人秉承全面风险管理的理念，建立了由公司董事会、经营层、督察长、监察稽核部和各业务部门构成的风险管理架构体系。基金管理人在董事会下设风险控制委员会，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等；在经营层下设风险管理委员会，负责讨论和制定公司及产品日常经营活动中风险防范和控制措施；公司设立监察稽核部，负责对公司及产品日常经营活动的风险管理进行监控、检查和报告，由督察长负责组织指导监察稽核工作；各业务部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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；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。

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2025年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券（2024年12月31日：同）。

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	2,952,788.42	-
合计	2,952,788.42	-

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。

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。

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。

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超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。于本报告期末，本基金未持有流动性受限资产。

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2025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48.84%，本基金投资组合的平均剩余期限为5天，平均剩余存续期为5天。

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。

于2025年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.13.4 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人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 2025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						
货币资金	26,062,156.10	-	-	-	-	26,062,156.10
结算备付金	339,833.26	-	-	-	-	339,833.26
存出保证金	23,384.59	-	-	-	-	23,384.59
交易性金融资产	2,952,788.42	-	-	-	-	2,952,788.42
买入返售金融资产	19,206,681.01	-	-	-	-	19,206,681.01
应收申购款	-	-	-	-	500.00	500.00
资产总计	48,584,843.38	-	-	-	500.00	48,585,343.38
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,868.45	4,868.45
应付托管费	-	-	-	-	1,622.81	1,622.81

应付销售服务费	-	-	-	-	3,679.13	3,679.13
应付利润	-	-	-	-	1,819.77	1,819.77
负债总计	-	-	-	-	11,990.16	11,990.16
利率敏感度缺口	48,584,843.38	-	-	-	-11,490.16	48,573,353.22
上年度末 2024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						
货币资金	1,540,536.08	-	-	-	-	1,540,536.08
结算备付金	16,262,754.45	-	-	-	-	16,262,754.45
买入返售金融资产	11,000,641.92	-	-	-	-	11,000,641.92
应收申购款	-	-	-	-	34,653.00	34,653.00
资产总计	28,803,932.45	-	-	-	34,653.00	28,838,585.45
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,760.91	3,760.91
应付托管费	-	-	-	-	1,253.64	1,253.64
应付销售服务费	-	-	-	-	3,760.91	3,760.91
应付利润	-	-	-	-	1,209.22	1,209.22
负债总计	-	-	-	-	9,984.68	9,984.68
利率敏感度缺口	28,803,932.45	-	-	-	24,668.32	28,828,600.77

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,367.84	-
	市场利率上升25个基点	-1,366.44	-

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。本基金主要投资于交易所市场和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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	2,952,788.42	-
第三层次	-	-
合计	2,952,788.42	-

6.4.14.2.2 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。
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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	2,952,788.42	6.08
	其中：债券	2,952,788.42	6.08
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	19,206,681.01	39.53
	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	26,401,989.36	54.34
4	其他各项资产	23,884.59	0.05
5	合计	48,585,343.38	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	-	
	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	5
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

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	94.78	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.10	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	3.15	-
	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		100.02	-

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	2,952,788.42	6.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,952,788.42	6.08
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	019723	23国债20	15,000	1,528,263.44	3.15
2	019683	22国债18	10,000	1,019,532.57	2.10
3	102274	国债2415	4,000	404,992.41	0.83

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	0.0133%
报告期内偏离度的最低值	-0.0004%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0020%

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未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

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	23,384.59
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	500.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	23,884.59

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	5,292	5,397.38	68,006.65	0.24%	28,494,936.53	99.76%

日添利A						
先锋日添利B	3	6,670,136.68	20,010,410.04	100.00%	0.00	0.00%
合计	5,295	9,173.44	20,078,416.69	41.34%	28,494,936.53	58.66%

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	产品	10,006,226.51	20.60%
2	产品	5,002,091.77	10.30%
3	产品	5,002,091.76	10.30%
4	个人	826,329.19	1.70%
5	个人	630,649.53	1.30%
6	个人	517,493.63	1.07%
7	个人	473,593.33	0.98%
8	个人	454,445.85	0.94%
9	个人	410,178.81	0.84%
10	个人	402,299.33	0.83%

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	15,843.45	0.06%
	先锋日添利B	-	-
	合计	15,843.45	0.03%

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	先锋日添利A	0

和研究部门负责人持有本开放式基金	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	28,828,600.77	-
本报告期基金总申购份额	8,399,991.72	25,059,264.10
减：本报告期基金总赎回份额	8,665,649.31	5,048,854.06
本报告期期末基金份额总额	28,562,943.18	20,010,410.04

§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

本报告期内，基金管理人的原董事长、总经理、首席信息官与督察长已离任，新任董事长为王重昆，新任总经理为张帆，新任督察长为王重昆（兼）。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

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主营业务、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

本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025年01月24日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》的规定
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已采取整改措施
其他	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，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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：根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等相关法律法规要求，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服务；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)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。

(3)基金管理人根据证券公司交易单元交易量依据公司投研部门对证券公司投研服务的综合评分排名结果进行分配。
- 3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。

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
万联证券	132,603,856.37	100.00%	295,100,000.00	100.00%	-	-	-	-

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关于先锋日添利货币市场基金 2025 年“春节”假期前暂停代	中国证监会规定媒介	2025-01-03

	销渠道申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》		
2	先锋日添利货币市场基金2024年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-16
3	先锋基金管理有限公司旗下全部基金2024年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-01-16
4	先锋基金管理有限公司关于变更股权结构的公告	中国证监会规定媒介	2025-02-19
5	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-01
6	先锋日添利货币市场基金2024年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-28
7	先锋基金基金定期报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-03-28
8	先锋基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	中国证监会规定媒介	2025-03-29
9	先锋基金管理有限公司关于变更股权结构的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-29
10	先锋基金管理有限公司关于先锋日添利货币市场基金2025年“清明”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	中国证监会规定媒介	2025-04-01
11	先锋基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-07
12	先锋日添利货币市场基金2025年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
13	先锋基金管理有限公司旗下全部基金2025年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
14	先锋基金管理有限公司董事	中国证监会规定媒介	2025-04-24

	长变更公告		
15	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-24
16	先锋基金管理有限公司基金管理人董事在最近12个月内变更超过百分之五十的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-30
17	先锋基金管理有限公司关于北京办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-30
18	先锋基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-05-17
19	《关于先锋日添利货币市场基金 2025 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	中国证监会规定媒介	2025-05-28
20	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-07
21	先锋基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海攀赢金融信息服务有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-18

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250613 - 20250630	0.00	10,006,226.51	0.00	10,006,226.51	20.60%
产品特有风险							
(1) 特定投资者大额赎回导致的流动性风险 如果特定投资者大额赎回，为应对赎回，可能迫使基金以不适当的价格大量抛售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。							
(2) 特定投资者大额赎回导致的巨额赎回风险							

如果特定投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请。

（3）特定投资者大额赎回导致的基金资产净值较低的风险

如果特定投资者大额赎回导致基金资产净值较低，可能出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，继而触发基金合同终止条件导致基金无法继续存续。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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 《先锋日添利货币市场基金招募说明书》

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.6 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>

客服中心电话：400-815-9998

先锋基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日