

先锋日添利货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 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

报告送出日期:2017 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。本半年度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 2017 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 2017 年 04 月 14 日起至 2017 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	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	35
7.1 报告期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期债券回购融资情况	36
7.3 基金投资组合平均剩余期限	36
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	37
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	38
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	38
7.8 报告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	38
7.9 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
§9 开放式基金份额变动	40
§10 重大事件揭示	40

10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
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	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	42
10.9 其他重大事件	42
§11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 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	322,444,577.19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	38,636,860.25份	283,807,716.94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	王致远	阮劲松
	联系电话	010-58239898	010-66270109
	电子邮箱	wangzy@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		深圳市福田区深南中路3007号国际科技大厦3001	天津市河东区海河东路218号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街8号楼23层2306-2307单元	天津市河东区海河东路218号
邮政编码		100022	300012
法定代表人		张松孝	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	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xf-fund.com
基金半年度报告备置地点	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	北京市朝阳区建国门外大街8号楼23层2306-2307单元

§ 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(2017年04月14日-2017年06月30日)	
	先锋日添利A	先锋日添利B
本期已实现收益	289,142.19	1,433,335.99
本期利润	289,142.19	1,433,335.99
本期净值收益率	0.7397%	0.7929%

3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年06月30日)	
期末基金资产净值	38,636,860.25	283,807,716.94
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(2017年06月30日)	
累计净值收益率	0.7397%	0.7929%

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。

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

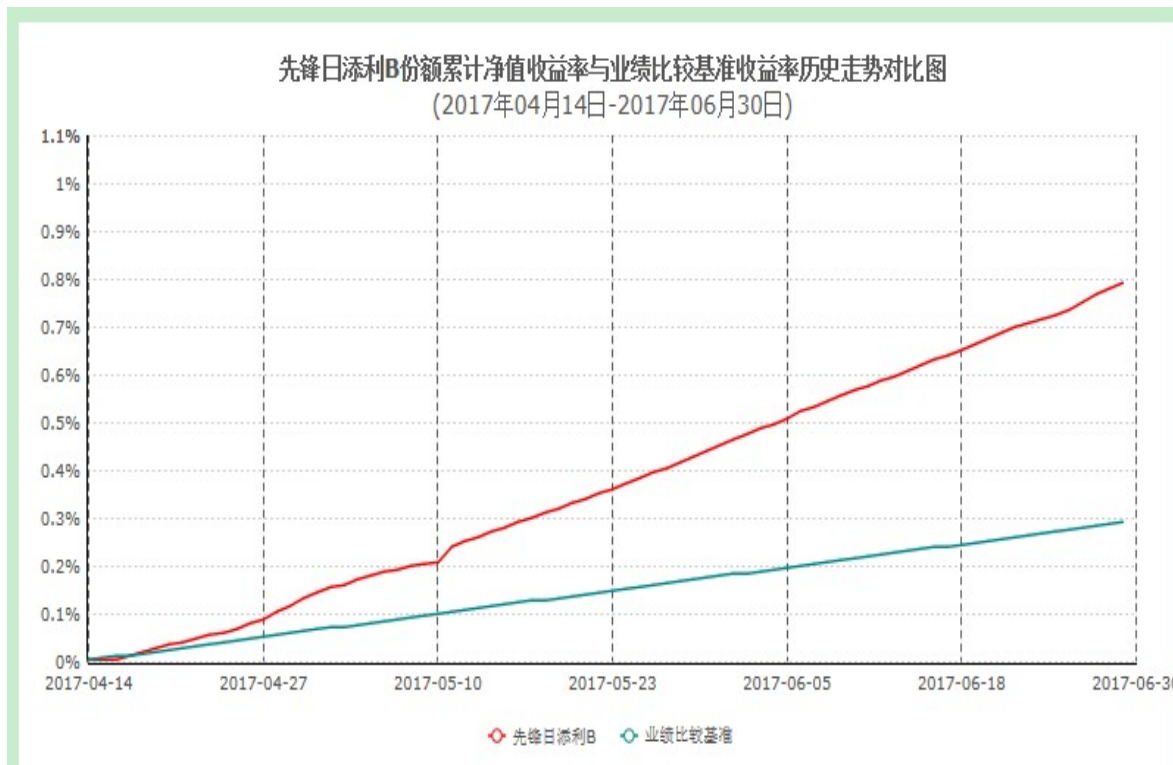
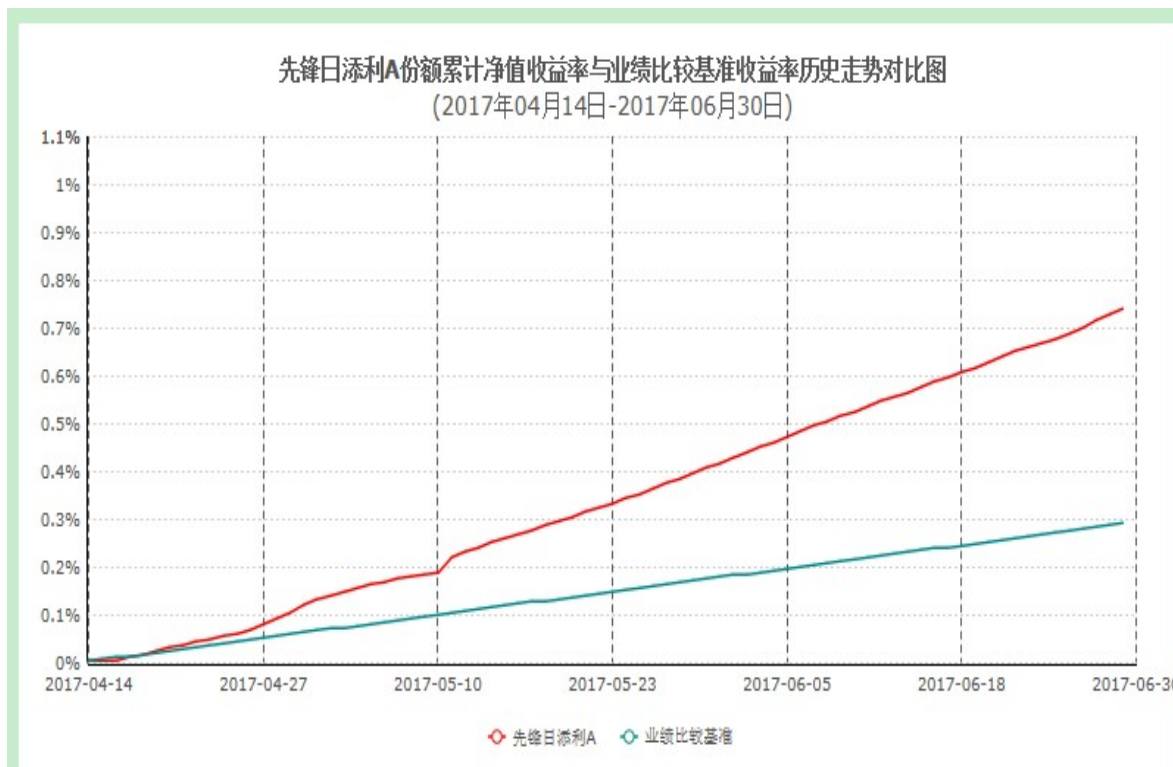
先锋日添利A

阶段	净值收益率①	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	0.3201%	0.0016%	0.1125%	0.0000%	0.2076%	0.0016%
自基金合同生效起至今	0.7397%	0.0036%	0.2925%	0.0000%	0.4472%	0.0036%

先锋日添利B

阶段	净值收益率①	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	0.3397%	0.0016%	0.1125%	0.0000%	0.2272%	0.0016%
自基金合同生效起至今	0.7929%	0.0036%	0.2925%	0.0000%	0.5004%	0.0036%

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：本基金合同于2017年4月14日生效。按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资限制”的有关约定。本报告期末本基金建仓期尚未结束。

§ 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 亿元人民币。其中，联合创业集团有限公司占注册资本的 38%，大连先锋投资管理有限公司占注册资本的 37%，北京鹏康投资有限公司占注册资本的 25%。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证券投资基金及先锋日添利货币市场基金 3 只开放式基金，资产管理规模 21.64 亿元。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王颢	投资研究部固定收益副总监、基金经理	2017-04-14	-	10 年	2007-2012 年曾任职于恒泰证券固定收益部，经历债券市场周期较长，对宏观经济政策及利率走势有着市场化的理解，能根据实际情况给予投资组合以准确定位，在保证投资收益的同时不断优化标的资产质量和提高组合流动性。2013-2014 年 12 月担任恒泰现金添利、恒泰稳健增利、恒泰创富 9 号、恒泰创富 25 号产品投资主办。
杜磊	基金经理	2017-04-21	-	5.5 年	美国伊利诺伊州立大学芝加哥分校工商管理硕士；2009-2010 年任职于大公国际资信评估有限公司信用评级部，任信用分析师；2011-2013 年 8 月任职于光大证券股份有限公司金融市场总部，从事固定收益投资交易工作，任高级经理；2013 年 8 月-2015 年 10 月任职于中信建投证券股

					份有限公司固定收益部，负责固定收益交易工作，历任高级经理和副总裁职务；2015 年 11 月-2016 年 4 月任职于兴业银行北京分行金融市场部，任投资经理。
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》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，为基金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和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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

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》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2017 年二季度债券市场继续调整，跌幅较上季度缩小，收益率曲线继续变平。二季度的下跌主要集中在 4-5 月，主要原因为 3 月份经济数据显著超预期；货币政策紧缩预期浓重；金融监管重重施压。进入 6 月后债券市场已经明显回暖，央行维持中性操作，金融机构平稳跨季。6 月资金面整体呈前紧后松态势，月初资金面小幅趋紧，央行超额续作 MLF 并积极投放流动性，维持资金面稳定；月中美联储加息央行未跟随上调货币政策工具利率，加息对国内资金面的冲击较小；月末财政存款下放流动性充裕，金融机构平稳跨越季末 MPA 考核，资金利率较 5 月末有所抬升，但上行幅度大幅弱于 3 月。

报告期内，本基金以管理流动性为第一要务，策略选择谨慎灵活，重点配置资金在关键的波动时点，同时密切跟踪持有人结构的变化，对申赎资金动向保持敏感，在

保证应对流动性的前提下，充分对比跟踪线上线下、场内场外、一级二级各种资产价格，择优锁定部分超调的短期资产；总体而言，本基金在二季度市场波动调整环境下，顺利地实现了流动性的平稳过渡，并为投资者获得了稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，先锋日添利 A 基金净值收益率为 0.7397%，先锋日添利 B 基金净值收益率为 0.7929%；同期业绩基准收益率为 0.2925%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计国内经济增速放缓，但回落幅度有限，总体保持平稳态势，通胀压力不大。

货币政策方面：2017 年以来，央行公开市场操作透明度加强，在一定程度上缓解了市场在资金面紧张时的恐慌情绪，减少了市场因与央行信息不对称而产生的非理性预期和猜疑，有利于央行达到维稳金融市场的政策目标。在美联储 6 月份加息后，央行没有跟随美联储上调公开市场利率，也是为了避免短期债券和货币市场利率进一步升高冲击金融市场和经济。从 6 月末央行公开市场操作释放的信号来看，央行对年中资金平稳程度的重视愈加明显。整体来看，在金融防风险、挤泡沫、去杠杆初见成效，同时下半年经济下行仍存在一定压力的情况下，三季度央行仍将实施稳健中性的货币政策，市场流动性可能仍处于紧中趋缓的状态。

财政政策方面：6 月份财政部连发三文，规范政府举债行为。50 号文曾要求对地方政府违规融资的清理整改工作最晚于 8 月底前完成，随着该时点的临近，7 月份清理政府违规融资的进度有可能提速。财政部一系列达到文件以及城投平台融资增速放缓对 PPP 项目的影 响会开始对基建投资造成影响。

从货币政策导向来看，上半年流动性是比较紧的，一个直观反映就是广义货币供应量 M2 同比增速 5 月份仅为 9.6%，已下降到历史低点。下半年市场流动性可能仍处于紧平衡状态，不会大幅宽松，但也不会再趋紧。货币政策中性依然是对债券市场底部的有效制约，下半年会是回归利率走廊的过程。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，

保证基金估值的公平、合理；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

无。

§ 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 托管人对本半年度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：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	60,499,993.05
结算备付金		100,000.00
存出保证金		4,916.84
交易性金融资产	6.4.7.2	99,828,149.17
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		99,828,149.17
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	161,717,813.53
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	455,803.46
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		322,606,676.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017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		55,036.78
应付托管费		12,841.92
应付销售服务费		5,687.17
应付交易费用	6.4.7.7	10,158.53
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		42,946.86
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	35,427.60
负债合计		162,098.86
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	322,444,577.19
未分配利润	6.4.7.10	-
所有者权益合计		322,444,577.19
负债和所有者权益总计		322,606,676.05

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 322,444,577.19 份，其中 A 类基金份额总额 38,636,860.25 份，基金份额净值 1.0000 元；B 类基金份额总额 283,807,716.94 份，基金份额净值 1.0000 元。

2、本基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日。

6.2 利润表

会计主体：先锋日添利货币市场基金

本报告期：2017年04月14日至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年04月14日至2017年06月30日
----	-----	---------------------------

一、收入		2,042,213.98
1. 利息收入		1,993,709.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	375,182.92
债券利息收入		701,419.42
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		917,107.27
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		42,290.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	42,290.67
资产支持证券投资收益		-
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	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,213.70
减：二、费用		319,735.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	146,538.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,192.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	31,885.79
4. 交易费用	6.4.7.19	-
5. 利息支出		71,291.70
其中：卖出回购金融资产支出		71,291.70
6. 其他费用	6.4.7.20	35,827.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,722,478.18
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,722,478.18

6.3 所有者权益（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：2017年04月14日至2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年04月14日（基金合同生效日）至2017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)	391,246,786.05	-	391,246,786.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,722,478.18	1,722,478.18
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）	-68,802,208.86	-	-68,802,208.86
其中：1. 基金申购款	454,362,570.15	-	454,362,570.15
2. 基金赎回款	-523,164,779.01	-	-523,164,779.01
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）	-	-1,722,478.18	-1,722,478.18
五、期末所有者权益（基金净值）	322,444,577.19	-	322,444,577.19

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：

基金管理人负责人：齐靠民 主管会计工作负责人：王益锋 会计机构负责人：刘岩

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”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]3072号《关于准予先锋日添利货币市场基金注册的批复》核准,由先锋基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《先锋日添利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,募集期间净认购资金总额为391,236,112.26元,认购资金在募集期间产生的利息为10,673.79元,本息合计391,246,786.05元,折合基金份额391,246,786.05份。以上业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第388号验资报告予以验证。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。本基金的基金管理人为先锋基金管理有限公司,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》并报中国证监会备案,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。本基金设A类和B类两类基金份额,两类基金份额单独设置基金代码,按照不同的费率计提销售服务费,并分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率,并适用自动升降级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《先锋日添利货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于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。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。

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于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《先锋日添利货币市场基金基金合同》和在财务报表附注

6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操

作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值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。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 06 月 30 日。

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) 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债券投资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。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

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。对于取得债券投资支付的价款中包含的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。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。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资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。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

为了避免债券投资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债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(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，但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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发

生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，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

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

债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后的净额确认为利息收入。

债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

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费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

每一级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按基金份额面值 1.00 元分配后转入所有者权益，每日支付收益。

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。

6.4.4.12 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，本基金计算影子价格过程中确定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：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

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 2017年06月30日
活期存款	499,993.05
定期存款	60,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	60,000,000.00
其他存款	-
合计	60,499,993.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2017年06月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	99,828,149.17	99,873,000.00	44,850.83	0.0139
	合计	99,828,149.17	99,873,000.00	44,850.83	0.0139

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2017年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	112,697,500.00	-
银行间市场	49,020,313.53	-
合计	161,717,813.53	-

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应收活期存款利息	93.81
应收定期存款利息	200,555.62
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	333.00
应收债券利息	98,575.85
应收买入返售证券利息	156,242.98
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.20
合计	455,803.46

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	10,158.53
合计	10,158.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	35,427.60
合计	35,427.60

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 先锋日添利A

金额单位：人民币元

项目 (先锋日添利A)	本期（基金合同生效日）2017年04月14日至2017年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	230,239,341.61	230,239,341.61
本期申购	69,060,912.33	69,060,912.33
本期赎回（以“-”号填列）	-260,663,393.69	-260,663,393.69

本期末	38,636,860.25	38,636,860.25
-----	---------------	---------------

6.4.7.9.2 先锋日添利B

金额单位：人民币元

项目 (先锋日添利B)	本期（基金合同生效日）2017年04月14日至2017年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	161,007,444.44	161,007,444.44
本期申购	385,301,657.82	385,301,657.82
本期赎回（以“-”号填列）	-262,501,385.32	-262,501,385.32
本期末	283,807,716.94	283,807,716.94

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2017 年 3 月 20 日至 2017 年 4 月 11 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 391,236,112.26 元（其中 A 类 230,236,112.26 元，B 类 161,000,000.00 元），募集期内认购资金产生的利息收入 10,673.79 元，其中 A 类基金份额 3,229.35 元，B 类基金份额 7,444.44 元，共折合基金份额 391,246,786.05 份，其中 A 类 230,239,341.61 份，B 类 161,007,444.44 份。

3. 本基金申购、赎回、转换和定期定额投资业务自 2017 年 4 月 24 日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 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	-	-	-
本期利润	289,142.19	-	289,142.19
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	-289,142.19	-	-289,142.19
本期末	-	-	-

6.4.7.10.2 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	-	-	-
本期利润	1,433,335.99	-	1,433,335.99
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	-1,433,335.99	-	-1,433,335.99
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年04月14日至2017年06月30日
活期存款利息收入	37,908.09
定期存款利息收入	312,886.18
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	21,222.46
其他	3,166.19
合计	375,182.92

6.4.7.12 股票投资收益

无。

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 2017年04月14日至2017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	42,290.67
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	42,290.67

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
	2017年04月14日至2017年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	131,487,158.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	129,897,700.42
减：应收利息总额	1,547,167.12
买卖债券差价收入	42,290.67

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年04月14日至2017年06月30日
基金赎回费收入	-
其他	6,213.70
合计	6,213.70

6.4.7.19 交易费用

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年04月14日至2017年06月30日
审计费用	16,076.58
信息披露费	19,351.02
其他	400.00
合计	35,827.60

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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
网信证券有限责任公司	基金管理人股东的子公司、基金销售机构

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

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
	2017年04月14日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	146,538.41

其中：支付销售机构的客户维护费	60,399.44
-----------------	-----------

注：管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年04月14日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,192.30

注：托管费按前一日基金资产净值 0.07% 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 × 0.07% / 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		
	2017年04月14日至2017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	22,541.26	1,969.64	24,510.90
网信证券	47.10	57.62	104.72
合计	22,588.36	2,027.26	24,615.62

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率 0.01%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 年销售服务费率 / 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
基金合同生效日（2017年04月14日）持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-

减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

先锋日添利B

份额单位：份

项目	本期
基金合同生效日（2017年04月14日）持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	57,832,486.32
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	31,000,000.00
报告期末持有的基金份额	26,832,486.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.32%

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

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 2017年04月14日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
渤海银行股份有限公司活期存款	499,993.05	37,908.09

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

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	应付利润本年变 动	利润分配 合计	备注

	出金额			
284,220.04	-	4,922.15	289,142.19	-

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	利润分配 合计	备注
1,395,311.28	-	38,024.71	1,433,335.99	-

6.4.12 期末（2017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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

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，

导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，并且通过分散化投资以降低信用风险。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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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 2017年6月30日
A-1	9,998,943.32
A-1 以下	
未评级	79,839,768.70
合计	89,838,712.02

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、同业存单。

6.4.13.2.2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 2017年6月30日
AAA	9,989,437.15
AAA 以下	
未评级	
合计	9,989,437.15

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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%。本基金所持证券均在证券交易所或银行间市场上市，金融资产均能以合理价格适时变现。

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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2017年06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	60,499,993.05	-	-	-	-	60,499,993.05

结算备付金	100,000.00	-	-	-	-	100,000.00
存出保证金	4,916.84	-	-	-	-	4,916.84
交易性金融资产	99,828,149.17	-	-	-	-	99,828,149.17
买入返售金融资产	161,717,813.53	-	-	-	-	161,717,813.53
应收利息	-	-	-	-	455,803.46	455,803.46
资产总计	322,150,872.59	-	-	-	455,803.46	322,606,676.05
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	55,036.78	55,036.78
应付托管费	-	-	-	-	12,841.92	12,841.92
应付销售服务费	-	-	-	-	5,687.17	5,687.17
应付交易费用	-	-	-	-	10,158.53	10,158.53
应付利润	-	-	-	-	42,946.86	42,946.86
其他负债	-	-	-	-	35,427.60	35,427.60
负债总计	-	-	-	-	162,098.86	162,098.86
利率敏感度缺口	322,150,872.59	-	-	-	293,704.60	322,444,577.19

注：表中所示基金资产及负债按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

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 2017年6月30日
	市场利率上升 25 个基点	-25,100.00
	市场利率下降 25 个基点	25,100.00

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 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) 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。

(b) 持续的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 2017 年 6 月 30 日，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中属于第二层次的余额为 99,828,149.17 元，无属于第一或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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。

(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 报告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	99,828,149.17	30.94
	其中：债券	99,828,149.17	30.94
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	161,717,813.53	50.13
	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	60,599,993.05	18.78
4	其他资产	460,720.30	0.14
5	合计	322,606,676.05	100.00

7.2 报告期债券回购融资情况

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	4.74	
	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

序号	正回购的资金余额超过基金资产净值20%的发生日期	货币市场基金债券融资余额占基金资产净值的比例 (%)	货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的原因	货币市场基金债券的调整期
1	2017-05-31	34.09	大额赎回	2个工作日

2	2017-06-01	34.27	大额赎回	1个工作日
---	------------	-------	------	-------

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	23
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	46
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 报告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	72.03	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	18.56	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	6.22	-
	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)	3.10	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.91	-

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 报告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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,067,352.67	6.22
	其中：政策性金融债	20,067,352.67	6.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,988,380.47	6.20
6	中期票据	-	-
7	同业存单	59,772,416.03	18.54
8	其他	-	-
9	合计	99,828,149.17	30.96
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 报告期末按摊余成本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)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	110217	11国开17	200,000	20,067,352.67	6.22
2	111710209	17兴业银行CD209	200,000	19,949,933.19	6.19
3	111708135	17中信银行CD135	200,000	19,915,320.14	6.18
4	071721005	17渤海证券CP005	100,000	9,998,943.32	3.10
5	011761032	17中电投SCP011	100,000	9,989,437.15	3.10
6	111719014	17恒丰银行CD014	100,000	9,968,231.02	3.09
7	111717025	17光大银行CD025	100,000	9,938,931.68	3.08

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0154%
报告期内偏离度的最低值	-0.0567%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0230%

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报告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没有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。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,916.84
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	455,803.46
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	460,720.30

7.9.4投资组合报告附注的其他文字描述

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	307	125,852.96	-	-	38,636,860.25	100.00
先锋日添利 B	16	17,737,982.31	214,752,702.13	75.67	69,055,014.81	24.33
合计	323	998,280.42	214,752,702.13	66.60	107,691,875.06	33.40

8.2 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	22,635.87	0.06
	先锋日添利 B	-	-
	合计	22,635.87	0.01

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	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	0~10
	先锋日添利 B	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	先锋日添利 A	-
	先锋日添利 B	-
	合计	-

§ 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	69,060,912.33	385,301,657.82
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	260,663,393.69	262,501,385.32
本报告期期末基金份额总额	38,636,860.25	283,807,716.94

§ 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重大人事变动:

督察长变更:2017年6月7日,本公司发布公告,聘任王致远先生为先锋基金管理有限公司督察长,同时华建强先生不再担任本公司督察长。

新任副总经理:2017年6月7日,本公司发布公告,聘任赵春来先生为先锋基金管理有限公司副总经理。

增聘基金经理:2017年4月22日,本公司发布公告,增聘杜磊为先锋日添利货币市场基金基金经理。

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、基金托管业务的诉讼。

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

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

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，本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) 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。

10.7.2 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 交总量 的比例 (%)	成交 金额	占当期 债券回 购交易 成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期 权证交 易成交 总额的 比例(%))	成交 金额	占当期 基金交 易成交 总额的 比例(%))
万联证券	19,99 0,000 .00	100.00	20,00 0,000 .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	先锋日添利货币市场基金基金合同	上海证券报、基金管理人网站	2017-03-17
2	先锋日添利货币市场基金托管协议	上海证券报、基金管理人网站	2017-03-17
3	先锋日添利货币市场基金招募说明书	上海证券报、基金管理人网站	2017-03-17
4	先锋日添利货币市场基金基金份额发售公告	上海证券报、基金管理人网站	2017-03-17
5	先锋日添利货币市场基金基金合同内容摘要	上海证券报、基金管理人网站	2017-03-17
6	先锋基金管理有限公司关于先锋日添利货币市场基金发售公告信息披露的更正公告	上海证券报、基金管理人网站	2017-03-18
7	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加金惠家保险代理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参加其费率优	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-03-22

	惠活动的公告		
8	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳秋实惠智财富投资管理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-03-27
9	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构及开通转换业务并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-04-10
10	先锋日添利货币市场基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站	2017-04-15
11	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为销售机构及开通定投和转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-04-21
12	先锋日添利货币市场基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	上海证券报、基金管理人网站	2017-04-21
13	先锋基金管理有限公司关于先锋日添利货币市场基金增聘基金经理的公告	上海证券报、基金管理人网站	2017-04-22
14	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加北京格上富信投资顾问有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-04-26
15	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-05-26
16	先锋基金管理有限公司关于旗下基金部	上海证券报、中国证	2017-06-08

	分销售机构更名的公告	券报、证券时报、基金管理人网站	
17	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加恒泰证券股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-06-23
18	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-06-28

§ 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

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	20170515-20170628	-	70,127,974.23	70,127,974.23	-	-
	2	20170426-20170613	-	57,832,486.32	31,000,000.00	26,832,486.32	8.32
	3	20170427-20170512	40,000,000.00	154,231.17	40,154,231.17	-	-
产品特有风险							
<p>(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。</p> <p>(2) 特定投资者大额赎回导致的巨额赎回风险</p>							

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 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 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
二〇一七年八月二十九