

先锋现金宝货币市场基金

2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:先锋基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 30 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 29 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。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 12 月 31 日。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 债券回购融资情况	52
8.3 基金投资组合平均剩余期限	53
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
8.6 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	55
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	56
8.8 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	57
8.9 投资组合报告附注	57
§9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58

9.4 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.....	59
§10 开放式基金份额变动.....	59
§11 重大事件揭示.....	59
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
11.2 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.....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4 基金投资策略的改变.....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	61
11.9 其他重大事件.....	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
12.1 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.....	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§13 备查文件目录.....	69
13.1 备查文件目录.....	69
13.2 存放地点.....	70
13.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	先锋现金宝货币市场基金
基金简称	先锋现金宝
基金主代码	003585
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月22日
基金管理人	先锋基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,635,738,062.22份
基金合同存续期	不定期

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王致远	罗菲菲
	联系电话	010-58239898	010-58560666
	电子邮箱	wangzy@xf-fund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-815-9998	95568
传真		010-58239896	010-58560798
注册地址		深圳市福田区深南中路3007号国际科技大厦3001	北京市西城区复兴门内大街2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	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		100022	100031
法定代表人		张松孝	洪崎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xf-fund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所	上海市黄浦区湖滨路202号普华永道

	(特殊普通合伙)	中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2017年	2016年11月22日(基金合同生效日) - 2016年12月31日
本期已实现收益	68,911,126.08	1,626,644.15
本期利润	68,911,126.08	1,626,644.15
本期净值收益率	4.0064%	0.3506%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末基金资产净值	2,635,738,062.22	1,029,548,870.58
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末
累计净值收益率	4.3711%	0.3506%

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

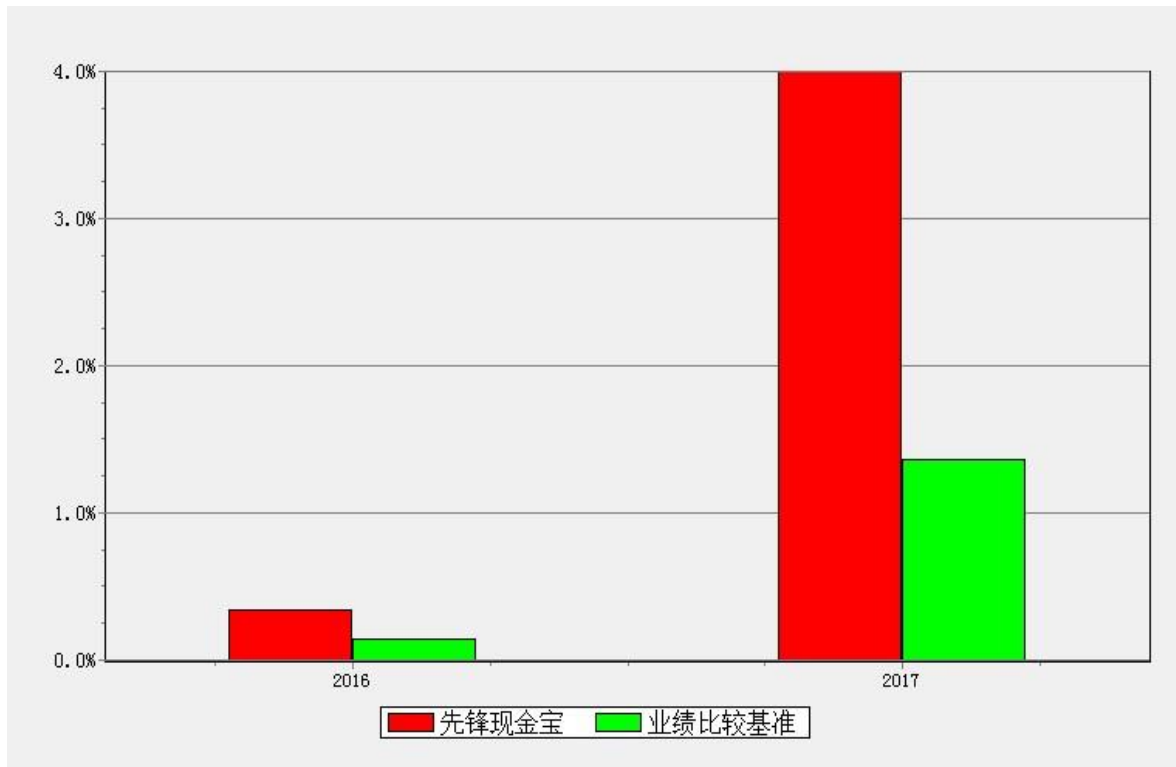
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.0451%	0.0010%	0.3450%	0.0000%	0.7001%	0.0010%
过去六个月	2.0517%	0.0011%	0.6900%	0.0000%	1.3617%	0.0011%
过去一年	4.0064%	0.0013%	1.3688%	0.0000%	2.6376%	0.0013%
自基金合同 生效起至今	4.3711%	0.0015%	1.5188%	0.0000%	2.8523%	0.0015%

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：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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分 配合计	备注
2017年	68,713.92 0.64	-	197,205.44	68,911.12 6.08	-
2016年	1,494,781. 38	-	131,862.77	1,626,644. 15	-
合计	70,208.70 2.02	-	329,068.21	70,537.77 0.23	-

§ 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，先锋基金旗下共管理 5 只开放式证券投资基金——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、先锋日添利货币市场基金、先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金、先锋聚元灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 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	2016-11- 22	-	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	2017-03-25	-	6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、本基金的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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），制定了《先锋基金管理有限公司公平交易制度》。该制度适用于

所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖所有投资品种，一级市场分销、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动，以及研究、授权、决策和执行等投资管理活动的各个环节，监察稽核部负责对公平交易制度执行情况进行实时监控。

4.3.2 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。

4.3.3 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，货币产品全年随着银行负债成本重构和监管规定的细化，收益得到上升、持仓品种流动性增强、质押品评级提高。先锋现金宝也在这一年里加强了与市场机构的沟通，各环节团队也得到了很好的锻炼磨合，能力和效率都得到了提升。顺应市场变化和自身规模增长在策略大方向上也不断调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末先锋现金宝基金份额净值为1.000元;本报告期内，基金份额净值增长率为4.0064%，同期业绩比较基准收益率为1.3688%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年初，在财政存款集中投放和长期金融去杠杆的背景下，可预见银行同业存款利率在年后短时期的大幅沉降和中长期的再次回升。因短期资产收益确定性强，策略趋同性较高，管理人将继续深化银行存款报价收集范围和降低融资成本来增厚产品收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。公司监察稽核部门在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对公司各项业务活动与相关制度等的合法性、合规性、合理性进行监督稽核、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全风险管理体系，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内向份额持有人分配利润 68,911,126.08 元；

4.9 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金实施利润分配金额为 68,911,126.08 元

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 20313 号

先锋现金宝货币市场基金全体基金份额持有人：

一、审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了先锋现金宝货币市场基金（以下简称“先锋现金宝”）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 11 月 22 日的资产负债表，2017 年度和 2016 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了先锋现金宝 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 11 月 22 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于先锋现金宝，并履行了职业道德方面的其他责任。

三、管理层和治理层对财务报表的责任

先锋现金宝的基金管理人先锋基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估先锋现金宝的持续经营能力，披露

与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算先锋现金宝、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督先锋现金宝的财务报告过程。

四、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对先锋现金宝持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致先锋现金宝不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天

注册会计师

会计师事务所(特殊普通合伙)

薛 竞

中国·上海市

注册会计师

2018 年 3 月 27 日

陈 轶 杰

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：先锋现金宝货币市场基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注 号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	685,427,745.24	130,423,244.69
结算备付金		—	5,092,115.62
存出保证金		—	2,186.39
交易性金融资产	7.4.7.2	625,898,890.21	189,024,492.06
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—

债券投资		625,898,890.21	189,024,492.06
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,477,417,870.60	708,000,435.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	10,508,153.48	2,392,776.35
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,799,252,659.53	1,034,935,250.11
负债和所有者权益	附注 号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		161,679,317.48	5,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		638,951.17	127,253.89
应付托管费		96,810.80	19,280.90
应付销售服务费		484,053.88	96,404.47
应付交易费用	7.4.7.7	28,047.16	3,174.70

应交税费		-	-
应付利息		50,348.61	3,402.80
应付利润		329,068.21	131,862.77
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	208,000.00	5,000.00
负债合计		163,514,597.31	5,386,379.53
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,635,738,062.22	1,029,548,870.58
未分配利润	7.4.7.1 0	-	-
所有者权益合计		2,635,738,062.22	1,029,548,870.58
负债和所有者权益总计		2,799,252,659.53	1,034,935,250.11

注：

1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,635,738,062.22 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 11 月 22 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：先锋现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注 号	本期2017年01月01 日至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年11月22日(基金 合同生效日)至2016 年12月31日
-----	---------	-----------------------------------	---

一、收入		82,818,874.03	1,980,684.98
1. 利息收入		82,519,241.48	1,980,684.98
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	28,823,020.51	640,091.34
债券利息收入		23,190,472.11	286,136.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		30,505,748.86	1,054,457.02
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		299,632.55	-
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	299,632.55	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7. 4. 7. 17	-	-
减：二、费用		13,907,747.95	354,040.83
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	5,756,957.01	151,305.91
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	872,266.30	22,925.15
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	4,361,331.11	114,625.71
4. 交易费用	7. 4. 7. 1 8	-	-
5. 利息支出		2,629,416.88	55,907.57
其中：卖出回购金融资产支出		2,629,416.88	55,907.57
6. 其他费用	7. 4. 7. 1 9	287,776.65	9,276.49
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		68,911,126.08	1,626,644.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,911,126.08	1,626,644.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：先锋现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	2017年01月01日至2017年12月31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)	1,029,548,870.58	-	1,029,548,870.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,911,126.08	68,911,126.08
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)	1,606,189,191.64	-	1,606,189,191.64
其中：1. 基金申购款	18,572,097,630.41	-	18,572,097,630.41
2. 基金赎回款	-16,965,908,438.77	-	-16,965,908,438.77
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)	-	-68,911,126.08	-68,911,126.08
五、期末所有者权益(基金净值)	2,635,738,062.22	-	2,635,738,062.22
项 目	上年度可比期间 2016年11月22日(基金合同生效日)至2016年12月31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)	348,356,567.88	-	348,356,567.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,626,644.15	1,626,644.15

证。经向中国证监会备案,《先锋现金宝货币市场基金基金合同》于2016年11月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为348,356,567.88份基金份额,其中认购资金利息折合8,993.15份基金份额。本基金的基金管理人为先锋基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《先锋现金宝货币市场基金基金合同》和《先锋现金宝货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金的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。本基金的业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)。

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2018年3月27日批准报出。

7.4.2 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》、《先锋现金宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度和2016年11月22日(基金合同生效日)至2016年12月31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2016年12月31日和2017年12月31日的财务状况以及2017年度和2016年11月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为2017年度和2016年11月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。本基金暂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。

7.4.4.4 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。对于取得债券投资或资产支持证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。

7.4.4.5 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性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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息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。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额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，每日宣告收益分配并将当日收益结转到投资人基金账户。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会

公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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）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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	1,927,745.24	423,244.69
定期存款	683,500,000.00	130,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	322,500,000.00	100,000,000.00
存款期限3个月-1年	361,000,000.00	30,000,000.00
其他存款	-	-
合计	685,427,745.24	130,423,244.69

注：定期存款期限指定期存款原始存续期限。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2017年12月31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	625,898,890.21	625,202,000.00	-696,890.21	-0.0264
	合计	625,898,890.21	625,202,000.00	-696,890.21	-0.0264
项目		上年度末2016年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度

					(%)
债券	交易所市场	29,985,301.19	29,961,000.00	-24,301.19	-0.0024
	银行间市场	159,039,190.87	159,032,000.00	-7,190.87	-0.0007
	合计	189,024,492.06	188,993,000.00	-31,492.06	-0.0031

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×100%。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,158,470,000.00	-
银行间市场	318,947,870.60	9,408,606.29
合计	1,477,417,870.60	9,408,606.29
项目	上年度末2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	578,000,000.00	-
银行间市场	130,000,435.00	-
合计	708,000,435.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日						
	债券代码	债券名称	约定 返售日	估值单 价	数量(张)	估值 总额	其中：已出 售或再质 押总额
1	111771793	17郑州银行 CD217	2018-01-04	94.91	100,000	9,491,000.00	-
合计	-	-	-	-	100,000	9,491,000.00	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日						
	债券代码	债券名称	约定 返售日	估值单 价	数量(张)	估值 总额	其中：已出 售或再质 押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	341.78	1,560.43
应收定期存款利息	6,627,917.83	313,437.43
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	29.75	2,073.81
应收债券利息	2,817,901.98	1,375,505.75
应收买入返售证券利息	1,061,962.14	700,197.83

应收申购款利息	-	-
其他	-	1.10
合计	10,508,153.48	2,392,776.35

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	28,047.16	3,174.70
合计	28,047.16	3,174.70

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
预提费用	208,000.00	5,000.00
合计	208,000.00	5,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,029,548,870.58	1,029,548,870.58
本期申购	18,572,097,630.41	18,572,097,630.41
本期赎回（以“-”号填列）	-16,965,908,438.77	-16,965,908,438.77
本期末	2,635,738,062.22	2,635,738,062.22

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2016年11月7日至2016年11月16日止期间公开发售，共募集有效净认购资金348,347,574.73元。根据《先锋现金宝货币市场基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入8,993.15元，折算为8,993.15份基金份额，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	68,911,126.08	-	68,911,126.08
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	-68,911,126.08	-	-68,911,126.08
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间2016年11月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日
活期存款利息收入	25,241.25	39,459.41
定期存款利息收入	28,444,537.06	582,381.87
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	36,871.26	7,462.57
其他	316,370.94	10,787.49
合计	28,823,020.51	640,091.34

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,679,359,037.20	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,667,679,024.95	-
减：应收利息总额	11,380,379.70	-
买卖债券差价收入	299,632.55	-

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

无。

7.4.7.16 公允价值变动收益

无。

7.4.7.17 其他收入

无。

7.4.7.18 交易费用

无。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月22日（基金合同生效 日）至2016年12月31日
审计费用	94,000.00	5,000.00
信息披露费	100,000.00	—
汇划手续费	55,301.05	3,876.49
帐户维护费	37,500.00	—
其他	975.60	400.00

合计	287,776.65	9,276.49
----	------------	----------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人于 2018 年 3 月 24 日发布的《先锋基金管理有限公司关于先锋现金宝货币市场基金修订基金合同、托管协议部分条款的公告》，基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，对本基金的基金合同和托管协议进行修改，修改内容包括本基金的投资限制和基金赎回费率等。

7.4.9 关联方关系

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
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	基金托管人
联合创业集团有限公司	基金管理人股东
大连先锋投资管理有限公司	基金管理人股东
北京鹏康投资有限公司	基金管理人股东
网信证券有限责任公司（“网信证券”）	受同一股东控制的其他企业、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；

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日 至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年11月22日（基金合同 生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,756,957.01	151,305.91
其中：支付销售机构的客户维护费	249,284.14	10,649.56

注：支付基金管理人先锋基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%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 × 0.33% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日 至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年11月22日（基金合同生 效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	872,266.30	22,925.15

注：支付基金托管人民生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。

7.4.10.2.3 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01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月22日（基金合同生效日） 至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费	当期发生的基金应支付的销售服务费
先锋基金	3,857,161.34	96,628.43
网信证券	4,184.20	592.04
合计	3,861,345.54	97,220.47

注：本基金销售服务费率为年费率0.25%。支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%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：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01 日至2017年12 月31日	上年度可比期 间 2016年11月22 日（基金合同生 效日）至2016年 12月31日

基金合同生效日（2016年11月22日）持有的基金份额	—	60,002,400.00
报告期初持有的基金份额	62,109,650.34	—
报告期间申购/买入总份额	60,718,661.33	6,207,250.34
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	122,828,311.67	4,100,000.00
报告期末持有的基金份额	—	62,109,650.34
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	6.03%

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年11月22日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行活期	1,927,745.24	25,241.25	423,244.69	39,459.41
民生银行定期	100,000,000.00	4,301,000.00	40,000,000.00	476,250.00

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况-货币市场基金

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
68,713,920.64	-	197,205.44	68,911,126.08	2017年
1,494,781.38	-	131,862.77	1,626,644.15	2016年

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额161,679,317.48元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
130212	13国开12	2018-01-05	100.06	500,000	50,031,156.24

170204	17国开04	2018-01-05	99.94	300,000	29,980,75 7.54
170211	17国开11	2018-01-05	99.30	200,000	19,860,83 0.20
170408	17农发08	2018-01-05	99.93	300,000	29,978,64 3.19
111787469	17河北银行 CD095	2018-01-02	99.67	210,000	20,930,72 8.62
111787469	17河北银行 CD095	2018-01-03	99.67	130,000	12,957,11 7.72
合计				1,640,000	163,739,23 3.51

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，属于低风险稳定收益品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资。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。本基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

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。

7.4.13.2 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和部分定期存款存放在本基金的托管行民生银行，其他定期存款存放在信用良好的商业银行，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，不投资于短期信用评级在AA+级以下或长期信用评级在AAA级以下的债券，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。本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。且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的净值产的10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 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	上年度末
--------	-----	------

	2017年12月31日	2016年12月31日
A-1	–	30,025,275.64
A-1以下	–	–
未评级	555,870,674.85	158,999,216.42
合计	555,870,674.85	189,024,492.06

注：未评级部分为政策性金融债和同业存单。

7.4.13.2 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12月31日	上年度末 2016年12月31日
AAA	–	–
AAA以下	–	–
未评级	70,028,215.36	–
合计	70,028,215.36	–

注：未评级部分为政策性金融债。

7.4.13.3 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2017年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有161,679,317.48元将在1个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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》(自2017年10月1日起施行)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2017年12月31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50.22%，本基金投资组合的平均剩余期限为28天，平均剩余存续期为28天。本基金持有的现金、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为64.65%。

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2017年12月31日，本基金持有流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为7.25%。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2017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	685,427,74 5.24	-	-	-	-	685,427,74 5.24
交易性金融资产	508,557,06 9.27	117,341,8 20.94	-	-	-	625,898,89 0.21
买入返售金融资产	1,477,417, 870.60	-	-	-	-	1,477,417, 870.60
应收利息	-	-	-	-	10,508,1 53.48	10,508,15 3.48
资产总计	2,671,402, 685.11	117,341,8 20.94	-	-	10,508,1 53.48	2,799,252, 659.53
负债						
卖出回购金融资产款	161,679,31 7.48	-	-	-	-	161,679,31 7.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	638,951. 17	638,951.17
应付托管费	-	-	-	-	96,810.8	96,810.80

					0	
应付销售服务费	-	-	-	-	484,053.88	484,053.88
应付交易费用	-	-	-	-	28,047.16	28,047.16
应付利息	-	-	-	-	50,348.61	50,348.61
应付利润	-	-	-	-	329,068.21	329,068.21
其他负债	-	-	-	-	208,000.00	208,000.00
负债总计	161,679,317.48	-	-	-	1,835,279.83	163,514,597.31
利率敏感度缺口	2,509,723,367.63	117,341,820.94	-	-	8,672,873.65	2,635,738,062.22
上年度末2016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	130,423,244.69	-	-	-	-	130,423,244.69
结算备付金	5,092,115.62	-	-	-	-	5,092,115.62
存出保证金	2,186.39	-	-	-	-	2,186.39
交易性金融资产	189,024,492.06	-	-	-	-	189,024,492.06
买入返售金融资	708,000,43	-	-	-	-	708,000,43

产	5.00					5.00
应收利息	-	-	-	-	2,392,776.35	2,392,776.35
资产总计	1,032,542,473.76	-	-	-	2,392,776.35	1,034,935,250.11
负债						
卖出回购金融资产款	5,000,000.00	-	-	-	-	5,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	127,253.89	127,253.89
应付托管费	-	-	-	-	19,280.90	19,280.90
应付销售服务费	-	-	-	-	96,404.47	96,404.47
应付交易费用	-	-	-	-	3,174.70	3,174.70
应付利息	-	-	-	-	3,402.80	3,402.80
应付利润	-	-	-	-	131,862.77	131,862.77
其他负债	-	-	-	-	5,000.00	5,000.00
负债总计	5,000,000.00	-	-	-	386,379.53	5,386,379.53
利率敏感度缺口	1,027,542,473.76	-	-	-	2,006,396.82	1,029,548,870.58

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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日	上年度末 2016年12月31日
	市场利率下降25个基点	297,130.05	87,887.53
	市场利率上升25个基点	-296,535.05	-87,621.71

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.14 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12月31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625,898,890.21元，无属于第一或第三层次的余额(2016年12月31日：第二层次189,024,492.06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。

(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12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016年12月31日：同)。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	625,898,890.21	22.36
	其中：债券	625,898,890.21	22.36
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	1,477,417,870.60	52.78
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	9,408,606.29	0.34
3	银行存款和结算备付金合计	685,427,745.24	24.49
4	其他各项资产	10,508,153.48	0.38
5	合计	2,799,252,659.53	100.00

8.2 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	4.63
	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	161,679,317.48	6.13
	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	发生日期	融资余额占基金 资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2017-03-22	20.77	大额赎回	1 个工作日
2	2017-04-28	35.08	大额赎回	5 个工作日
3	2017-05-02	21.76	大额赎回	4 个工作日
4	2017-05-03	21.77	大额赎回	3 个工作日
5	2017-05-04	22.77	大额赎回	2 个工作日
6	2017-05-05	20.04	大额赎回	1 个工作日
7	2017-07-04	23.29	大额赎回	2 个工作日
8	2017-07-05	26.74	大额赎回	1 个工作日
9	2017-11-23	20.80	大额赎回	1 个工作日

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	28
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

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。

8.3.2 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	73.17	6.13
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	13.00	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	14.05	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	1.14	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	4.45	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		105.81	6.13

8.4 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。

8.5 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	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	149,848,446.29	5.69
	其中：政策性金融债	149,848,446.29	5.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	476,050,443.92	18.06
8	其他	-	-
9	合计	625,898,890.21	23.75
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	111716213	17上海银行CD21 3	1,200,000	119,878,30 1.61	4.55
2	111793272	17南京银行CD03 8	1,000,000	99,215,825. 13	3.76

3	111781362	17广州农村商业银行CD130	1,000,000	97,480,990.74	3.70
4	111719333	17恒丰银行CD333	700,000	69,771,467.07	2.65
5	111787469	17河北银行CD095	600,000	59,802,081.78	2.27
6	130212	13国开12	500,000	50,031,156.24	1.90
7	170204	17国开04	300,000	29,980,757.54	1.14
8	170408	17农发08	300,000	29,978,643.19	1.14
9	111710540	17兴业银行CD540	300,000	29,901,777.59	1.13
10	150201	15国开01	200,000	19,997,059.12	0.76

8.7 “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	0.0437%
报告期内偏离度的最低值	-0.1069%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0209%

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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	应收证券清算款	—
3	应收利息	10,508,153.48
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	10,508,153.48

8.9.4 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,376	780,728.10	2,098,613,504.87	79.62%	537,124,557.35	20.38%

9.2 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[1]	持有份额（份）	占总份额比例
1	其他机构	232,047,903.74	8.80%
2	券商类机构	203,046,349.37	7.70%
3	券商类机构	150,017,996.78	5.69%
4	信托类机构	141,377,187.69	5.36%
5	个人	100,079,387.20	3.80%
6	信托类机构	100,079,387.20	3.80%
7	其他机构	100,033,549.64	3.80%
8	券商类机构	100,011,997.85	3.79%
9	个人	99,055,674.55	3.76%
10	券商类机构	98,000,000.00	3.72%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	33,797.20	0.0013%
------------------	-----------	---------

9.4 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年11月22日)基金份额总额	348,356,567.88
本报告期期初基金份额总额	1,029,548,870.58
本报告期基金总申购份额	18,572,097,630.41
减：本报告期基金总赎回份额	16,965,908,438.77
本报告期期末基金份额总额	2,635,738,062.22

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 根据本基金管理人2017年6月7日公告，聘任赵春来先生为公司副总经理，聘任王致远先生为公司督察长，华建强先生因个人原因离任公司督察长。

2. 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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。本报告期内本基金应付审计费 99,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
网信证券	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

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、个股分析的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。

11.7.2 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
网信证券	112,040,936.46	100.00%	139,200,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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。

11.9 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 2016 年 12 月 31 日基金资产净值公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-01-03

2	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-01-17
3	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-01-18
4	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-01-20
5	先锋现金宝货币市场基金 2017 年“春节”假期前暂停申购业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2017-01-23
6	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-02-07
7	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构及开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-03-01
8	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-03-10
9	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惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-03-22
10	先锋基金管理有限公司关于先锋现金宝货币市场基金增聘基金经理的公告	中国证券报、基金管理人网站	2017-03-25
11	先锋基金管理有限公司关于旗下基	中国证券报、证券时	2017-03-27

	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	报、上海证券报、基金管理人网站	
12	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	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-04-10
13	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2017-04-12
14	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	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-04-21
15	先锋现金宝货币市场基金 2017 年第一季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2017-04-21
16	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	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-04-26
17	先锋现金宝货币市场基金 2017 年“五一”假期前暂停申购、转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2017-04-26
18	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加广发证券股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2017-05-03

19	先锋现金宝货币市场基金 2017 年“端午”假期前暂停申购、转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2017-05-24
20	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	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-05-26
21	先锋基金管理有限公司关于旗下基金部分销售机构更名的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-06-08
22	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	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-06-23
23	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	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-06-28
24	先锋基金管理有限公司 2017 年 6 月 30 日基金资产净值公告	基金管理人网站	2017-07-01
25	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加爱建证券有限责任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	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-07-05
26	先锋现金宝货币市场基金招募说明书（更新）2017 年第 1 号	基金管理人网站	2017-07-05
27	先锋现金宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要 2017 年第 1 号	中国证券报、基金管理人网站	2017-07-05
28	先锋现金宝货币市场基金 2017 年第	中国证券报、基金管	2017-07-21

	二季度报告	理人网站	
29	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加天津万家财富资产管理有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-08-01
30	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加交通银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-08-04
31	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-08-08
32	先锋基金管理有限公司关于江苏汇林保大基金销售有限公司开通先锋基金旗下部分基金定投、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-08-11
33	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加上海云湾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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-08-23
34	先锋基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-08-25
35	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人	2017-08-28

		网站	
36	先锋现金宝货币市场基金 2017 年半年度报告	基金管理人网站	2017-08-29
37	先锋现金宝货币市场基金 2017 年半年度报告摘要	中国证券报、基金管理人网站	2017-08-29
38	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加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	中国证券报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-08-30
39	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加民生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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-09-01
40	先锋基金管理有限公司关于旗下基金部分销售机构更名的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-09-21
41	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加和讯信息科技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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-09-25
42	先锋现金宝货币市场基金 2017 年“国庆”假期前暂停申购、转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2017-09-27
43	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加华泰期货有限公司为销售机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017-09-29
44	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券股份有限公司为销	中国证券报、证券时报、上海证券报、证	2017-10-12

	售机构及开通转换业务并参加其费率优惠活动的公告	券日报、基金管理人网站	
45	先锋基金管理有限公司关于交通银行股份有限公司开通先锋基金旗下部分基金定投、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-10-17
46	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构及开通转换业务并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-10-26
47	先锋现金宝货币市场基金 2017 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2017-10-26
48	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加新时代证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2017-11-22
49	先锋基金管理有限公司关于华泰证券股份有限公司开通先锋基金旗下部分基金定投业务并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-12-05
50	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加喜鹊财富基金销售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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-12-05
51	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加国都证券股份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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-12-08
52	先锋基金管理有限公司关于参加泰	中国证券报、证券时	2017-12-15

	诚财富基金销售（大连）有限公司费率优惠活动的公告	报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	
53	先锋基金管理有限公司关于旗下基金增加国信证券股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2017-12-22
54	先锋现金宝货币市场基金 2018 年“元旦”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2017-12-28
55	关于先锋基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金自 2018 年 1 月 1 日起缴纳增值税的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站	2017-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20170105-20170407	50,071,823.83	621,182,200.69	671,254,024.52	0.00	-
	2	20170118-20170222	0.00	452,246,836.50	452,246,836.50	0.00	-
	3	20170215-20170320;	0.00	2,676,873,800.85	2,626,867,512.87	50,006,287.98	1.90%

	20170714- 20170718; 20171201- 20171224					
4	20170614- 20170628; 20170704- 20170710	0.00	300,863,30 7.05	300,863,307. 05	0.00	-
5	20171009- 20171019	0.00	511,772,49 3.20	511,772,493. 20	0.00	-

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证券监督管理委员会批准先锋现金宝货币市场基金设立的文件

13.1.2 《先锋现金宝货币市场基金基金合同》

13.1.3 《先锋现金宝货币市场基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

13.1.5 报告期内先锋现金宝货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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

二〇一八年三月三十日