

# 先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 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:华夏银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月27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2023年01月01日起至2023年12月31日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
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.....	14
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表 .....	19
7.3 净资产变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	60
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	60

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	61
§9 基金份额持有人信息 .....	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
9.3 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 .....	62
§10 开放式基金份额变动 .....	63
§11 重大事件揭示 .....	63
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.8 其他重大事件 .....	65
§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 .....	68
§13 备查文件目录 .....	69
13.1 备查文件目录 .....	69
13.2 存放地点 .....	69
13.3 查阅方式 .....	69

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	先锋聚利	
基金主代码	004833	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年05月09日	
基金管理人	先锋基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,155,782.15份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	先锋聚利A	先锋聚利C
下属分级基金的交易代码	004833	004834
报告期末下属分级基金的份额总额	2,401,722.16份	1,754,059.99份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以资产配置为导向，在股票、债券、短期金融工具等之间进行动态选择，在控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	从宏观经济环境和证券市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的风险收益水平，动态调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例，优化投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+中债总指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 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	华夏银行股份有限公司
信息披露	姓名	黄劲松	朱绍纲

露负责人	联系电话	400-815-9998	(010) 85238309
	电子邮箱	heguifengkong@xf-fund.com	zhzsg@hxb.com.cn
客户服务电话		400-815-9998	95577
传真		010-58239896	(010) 85238680
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	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
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	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
邮政编码		518046	100005
法定代表人		Wong Leah Kuen	李民吉

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xf-fund.com">http://www.xf-fund.com</a>
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	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	广东省广州市黄埔区黄埔大道东856号保利鱼珠港A2栋4楼
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、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	2023年		2022年		2021年	
	先锋聚利A	先锋聚利C	先锋聚利A	先锋聚利C	先锋聚利A	先锋聚利C
本期已实现收益	-145,374.34	-70,315.56	-571,907.56	-280,349.83	20,260.65	359.17
本期利润	173,208.85	186,814.53	-1,208,330.80	-393,234.82	4,990.58	26,764.96
加权平均基金份额本期利润	0.0616	0.0848	-0.4928	-0.1700	0.0049	0.0103
本期加权平均净值利润率	7.13%	10.02%	-55.20%	-19.18%	0.54%	1.16%
本期基金份额净值增长率	4.73%	4.53%	-13.88%	-14.07%	-4.94%	-5.14%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	-833,090.45	-638,003.22	-1,144,630.45	-842,393.20	-179,173.48	-407,256.03
期末可供分配基金份额利润	-0.3469	-0.3637	-0.3049	-0.3210	-0.1685	-0.1854
期末基金资产净值	1,976,910.06	1,411,506.13	2,949,796.14	2,020,504.98	970,519.49	1,967,938.32
期末基金份额净值	0.8231	0.8047	0.7859	0.7698	0.9126	0.8958
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	-17.69%	-19.53%	-21.41%	-23.02%	-8.74%	-10.42%

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

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

先锋聚利A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.07%	1.12%	-3.25%	0.44%	1.18%	0.68%
过去六个月	-6.65%	0.97%	-5.05%	0.46%	-1.60%	0.51%
过去一年	4.73%	1.08%	-4.27%	0.46%	9.00%	0.62%
过去三年	-14.26%	1.44%	-14.62%	0.61%	0.36%	0.83%
过去五年	4.87%	1.38%	20.72%	0.66%	-15.85%	0.72%
自基金合同生效起至今	-17.69%	1.36%	8.25%	0.67%	-25.94%	0.69%

先锋聚利C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.13%	1.12%	-3.25%	0.44%	1.12%	0.68%
过去六个月	-6.73%	0.97%	-5.05%	0.46%	-1.68%	0.51%
过去一年	4.53%	1.08%	-4.27%	0.46%	8.80%	0.62%
过去三年	-14.78%	1.44%	-14.62%	0.61%	-0.16%	0.83%
过去五年	2.67%	1.38%	20.72%	0.66%	-18.05%	0.72%
自基金合同生效起至今	-19.53%	1.36%	8.25%	0.67%	-27.78%	0.69%

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



先锋聚利A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年05月09日-2023年12月31日)

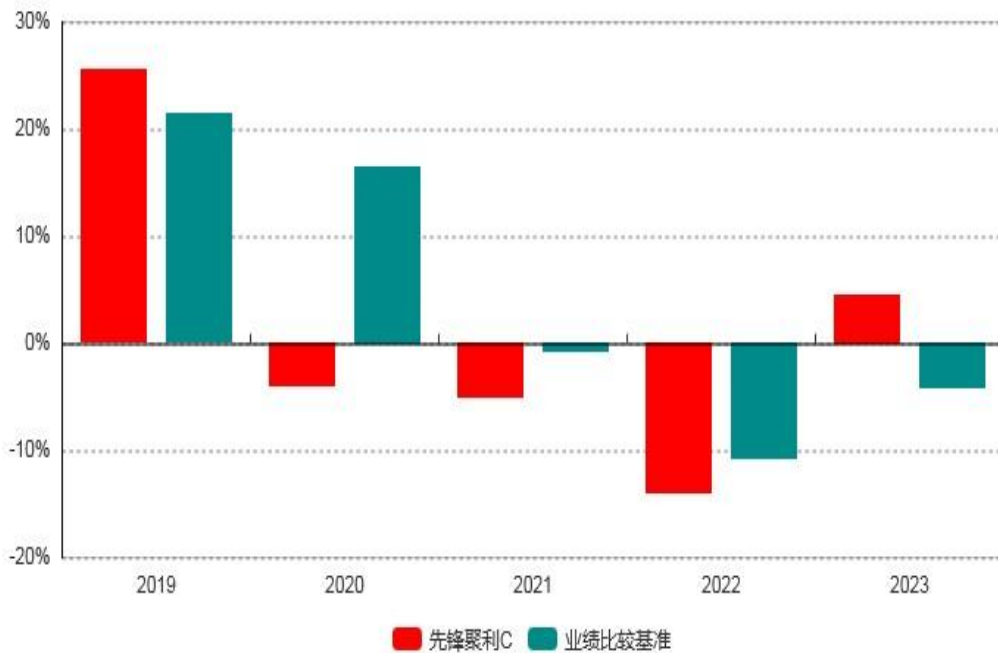
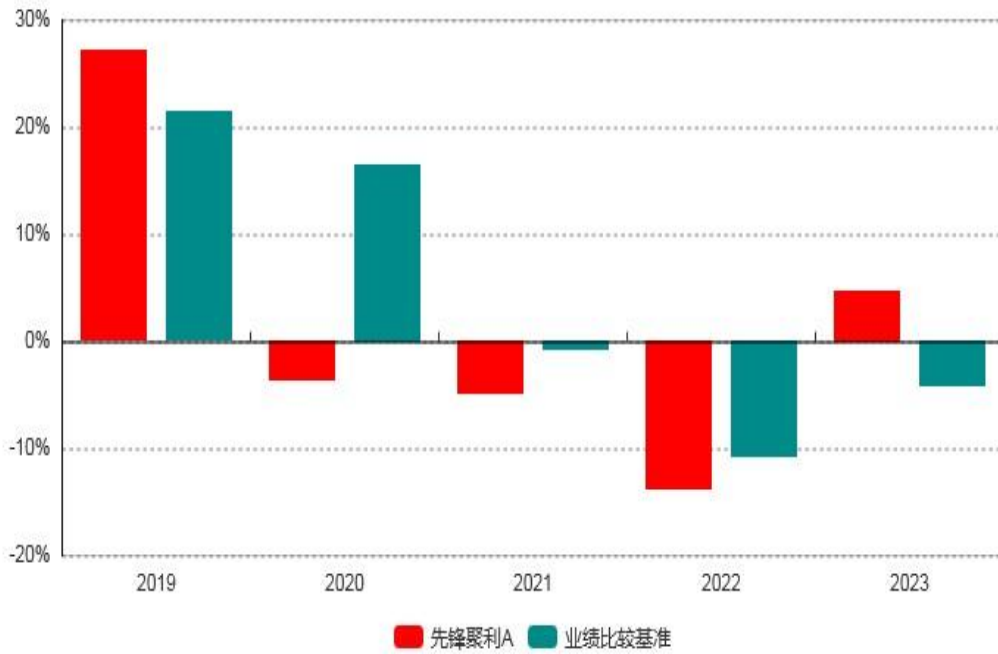


先锋聚利C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年05月09日-2023年12月31日)



注：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。

### 3.2.3 过去五年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

无。

## §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1.5亿元人民币。其中,联合创业集团有限公司占注册资本的34.2076%,大连亚联投资管理有限公司占注册资本的33.3074%,北京鹏康投资有限公司占注册资本的22.5050%,北京指南针科技发展股份有限公司占注册资本的4.9900%,深圳大华信安私募证券基金管理企业(有限合伙)占注册资本的4.9900%。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		
曾捷	基金经理	2022-12-28	-	9年	北京航空航天大学工学硕士,曾任安信证券股份有限公司研究员、华金证券股份有限公司研究员。2021年6月加入先锋基金管理有限公司任研究员。

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用

基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规及基金合同的约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本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》，制定了《先锋基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合及所有投资管理活动，贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待公司旗下的全部投资组合。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 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

从宽基指数和体感上看，2023年的A股是一个弱势熊市，但实际上5400家上市公司中，有45%的公司下跌，有55%以上公司上涨，体现为体现为杠铃策略在2023年非常有效。复盘2023年，一季度，考虑到弱复苏的背景，AI引领的科技产业浪潮，半导体的周期运行周期节奏，国产替代的趋势，本基金主要投资于科技成长领域，尤其增加了优质半导体设计公司的持仓，基金净值回升。二季度，经济复苏数据弱，市场从强预期下向现实回摆，本基金继续保持了TMT的配置持仓，基金净值出现一定回撤。三季度，是政策的拐点，行业上券商、地产、石化、建材等与保增长和活跃资本市场政策相关的周期

性行业领涨，而华为发布mate60手机引领了一波电子产业链行情，本基金净值相对平稳。四季度，市场呈现调整态势，本基金净值也发生一定回撤。2023年报告期内，本基金重点配置以TMT成长股为主，在运作过程中保持风格稳定。复盘本报告期，本基金在节点的把握上，还有继续提升的空间，将争取可以做的更好。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末先锋聚利A基金份额净值为0.8231元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.73%，同期业绩比较基准收益率为-4.27%；截至报告期末先锋聚利C基金份额净值为0.8047元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.53%，同期业绩比较基准收益率为-4.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们倾向于认为现在经济正处于多重周期的底部，虽然24年的经济内生动能或难言大的反转，但应该又比23年好，疫情疤痕效应的缓释、库存周期的底部起来、PPI也很难再差。如果没有超强刺激政策出现，经济弱复苏的背景下，哑铃策略可能依旧有效。但我们更倾向于结合自身研究领域优势，在TMT领域着重配置。此外，我们会持续关注投资组合的抗风险能力，力争减少净值波动，争取为基金持有人创造长期可持续的较高投资收益。

#### 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，本基金管理人按照国家相关法律法规和公司内部规章制度持续推进监察稽核各项工作，不断强化内部管理、提升自身合规风控能力。公司通过各项合规管理措施对基金的投资运作、销售宣传、基金运营、信息披露、投资者适当性管理、反洗钱等进行了重点监控与稽核，对公司各项业务开展的合法性、合规性、合理性进行监督稽核、评价、报告和建议，并开展了多形式的合规培训，强化员工职业道德教育和合规意识培育，从源头上防范合规风险，确保各项法规和管理制度有效落实。

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，不断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**

本基金报告期内未进行利润分配。

#### **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**

自2020年3月2日起至本报告期末，本基金的基金资产净值存在连续二十个工作日低于5000万元的情形，至本报告期期末基金资产净值仍低于5000万元。

至本报告期末，本基金存在连续超六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人前期已按照基金合同约定向中国证监会报告并提出解决方案。持续营销严格遵循法律法规，注重风险揭示与投资者适当性管理，精准市场定位，多元化渠道布局，持续优化客户服务。

### **§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**

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### **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**

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

#### **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**

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2023年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审〔2024〕7-96号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称先锋聚利基金)财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表和净资产变动表，以及相关财务报表附注。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，公允反映了先锋聚利基金2023年12月31日的财务状况，以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于先锋聚利基金及其管理人先锋基金管理有限公司（以下简称基金管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-

<p>其他信息</p>	<p>基金管理人管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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，管理层负责评估先锋聚利基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理层计划清算先锋聚利基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层（以下简称治理层）负责监督先锋聚利基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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</p>



	<p>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，就可能对先锋聚利基金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聚利基金不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就基金的审计范围、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。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>天健会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>燕玉嵩、黄燕</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>广东省广州市黄埔区黄埔大道东856号保利鱼珠港A2栋4楼</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2024-03-27</p>

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	1,565,190.24	390,865.99
结算备付金		9,434.76	12,106.03
存出保证金		5,552.37	8,532.87
交易性金融资产	7.4.7.2	1,973,611.37	4,611,312.54
其中：股票投资		1,973,611.37	4,611,312.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	507,000.00	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		500.00	1,472.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		4,061,288.74	5,024,290.08
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		608,217.33	-
应付赎回款		19,711.84	1,095.31
应付管理人报酬		3,455.02	5,033.93
应付托管费		287.93	419.51
应付销售服务费		237.67	333.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	40,962.76	47,106.83
负债合计		672,872.55	53,988.96
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	4,155,782.15	6,378,140.43
未分配利润	7.4.7.8	-767,365.96	-1,407,839.31
净资产合计		3,388,416.19	4,970,301.12
负债和净资产总计		4,061,288.74	5,024,290.08

注：截至2023年12月31日止，基金份额总额4,155,782.15份，其中A类基金份额净值0.8231元，基金份额为2,401,722.16份；C类基金份额净值0.8047元，基金份额为1,754,059.99份。

## 7.2 利润表

会计主体：先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		414,639.01	-1,542,844.27
1.利息收入		18,619.43	1,883.69
其中：存款利息收入	7.4.7.9	4,814.06	1,883.69
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		13,805.37	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-187,394.08	-824,965.23
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-198,133.03	-871,408.32
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	40,815.42
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.14	10,738.95	5,627.67
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	575,713.28	-749,308.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	7,700.38	29,545.50
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>54,615.63</b>	<b>58,721.35</b>
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	51,658.76	50,456.35
2.托管费	7.4.10.2.2	4,304.84	4,204.75
3.销售服务费	7.4.10.2.3	3,734.44	4,060.25
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	7.4.7.17	-	-

7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.18	-5,082.41	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		360,023.38	-1,601,565.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		360,023.38	-1,601,565.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		360,023.38	-1,601,565.62

### 7.3 净资产变动表

会计主体：先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,378,140.43	-1,407,839.31	4,970,301.12
二、本期期初净资产	6,378,140.43	-1,407,839.31	4,970,301.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,222,358.28	640,473.35	-1,581,884.93
（一）、综合收益总额	-	360,023.38	360,023.38
（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）	-2,222,358.28	280,449.97	-1,941,908.31

其中：1.基金申购款	3,161,646.42	-469,096.78	2,692,549.64
2.基金赎回款	-5,384,004.70	749,546.75	-4,634,457.95
（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）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	4,155,782.15	-767,365.96	3,388,416.19
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,260,246.51	-321,788.70	2,938,457.81
二、本期期初净资产	3,260,246.51	-321,788.70	2,938,457.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,117,893.92	-1,086,050.61	2,031,843.31
（一）、综合收益总额	-	-1,601,565.62	-1,601,565.62
（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）	3,117,893.92	515,515.01	3,633,408.93
其中：1.基金申购款	13,510,725.80	-342,952.85	13,167,772.95
2.基金赎回款	-10,392,831.88	858,467.86	-9,534,364.02
（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）			
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	6,378,140.43	-1,407,839.31	4,970,301.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

龙涌

吴越

谢玲玉

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金(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)《关于准予先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2017〕868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》《先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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208,395,378.09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〔2018〕第0270号)。经向证监会备案,《先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年5月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为208,423,328.12份,其中认购资金利息折合27,950.03份基金份额。本基金的管理人为先锋基金公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司(以下简称华夏银行)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资范围为:具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)权证、国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、资产支持证券、次级债、同业存单、债券回购、银行存款、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以

后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。股票投资占基金资产的比例范围为0-95%。本基金每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+中债总指数收益率×45%。

本财务报表由本基金的基金管理人先锋基金公司于2024年3月27日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2023年内，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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

本基金财务报表符合企业会计准则和财政部《资产管理产品相关会计处理规定》(财会〔2022〕14号)、中国证券投资基金业协会(以下简称中国基金业协会)《证券投资基金会计核算业务指引》的要求，并按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》编制，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产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。

##### 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

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

###### 1. 金融资产的分类



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

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

(1) 以摊余成本计量：

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

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## 2. 金融负债的分类

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

### 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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

#### 7.4.4.10 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(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

1. 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告〔2017〕13号)，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2. 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发〔2017〕6号)之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称指引)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

3. 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》及中国基金业协会中基协字〔2022〕566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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债金融估值中心有限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

无。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税〔2002〕128号)、《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股票、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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	1,565,190.24	390,865.99
等于：本金	1,565,031.26	390,822.88
加：应计利息	158.98	43.11
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	1,565,190.24	390,865.99

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,111,186.15	-	1,973,611.37	-137,574.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,111,186.15	-	1,973,611.37	-137,574.78
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,324,600.60	-	4,611,312.54	-713,288.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-



其他	-	-	-	-
合计	5,324,600.60	-	4,611,312.54	-713,288.06

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 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 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	507,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	507,000.00	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

### 7.4.7.5 其他资产

无。

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	15.65	-
应付交易费用	3,356.79	4,434.10
其中：交易所市场	3,356.79	4,434.10
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	37,590.32	42,672.73
合计	40,962.76	47,106.83

### 7.4.7.7 实收基金

#### 7.4.7.7.1 先锋聚利A

金额单位：人民币元

项目 (先锋聚利A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,753,583.00	3,753,583.00
本期申购	483,371.87	483,371.87
本期赎回（以“-”号填列）	-1,835,232.71	-1,835,232.71
本期末	2,401,722.16	2,401,722.16

#### 7.4.7.7.2 先锋聚利C

金额单位：人民币元

项目 (先锋聚利C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,624,557.43	2,624,557.43
本期申购	2,678,274.55	2,678,274.55
本期赎回（以“-”号填列）	-3,548,771.99	-3,548,771.99
本期末	1,754,059.99	1,754,059.99

注：

申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 7.4.7.8 未分配利润

### 7.4.7.8.1 先锋聚利A

单位：人民币元

项目 (先锋聚利A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,144,630.45	340,843.59	-803,786.86
本期期初	-1,144,630.45	340,843.59	-803,786.86
本期利润	-145,374.34	318,583.19	173,208.85
本期基金份额交易产生的变动数	456,914.34	-251,148.43	205,765.91
其中：基金申购款	-164,159.93	99,180.69	-64,979.24
基金赎回款	621,074.27	-350,329.12	270,745.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-833,090.45	408,278.35	-424,812.10

### 7.4.7.8.2 先锋聚利C

单位：人民币元

项目 (先锋聚利C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-842,393.20	238,340.75	-604,052.45
本期期初	-842,393.20	238,340.75	-604,052.45
本期利润	-70,315.56	257,130.09	186,814.53
本期基金份额交易产生的变动数	274,705.54	-200,021.48	74,684.06
其中：基金申购款	-955,512.27	551,394.73	-404,117.54
基金赎回款	1,230,217.81	-751,416.21	478,801.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-638,003.22	295,449.36	-342,553.86

### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年

	12月31日	12月31日
活期存款利息收入	3,653.61	1,550.46
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	1,040.83	251.33
其他	119.62	81.90
合计	4,814.06	1,883.69

[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

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	22,452,054.09	17,201,576.42
减：卖出股票成本总额	22,600,650.17	18,035,500.66
减：交易费用	49,536.95	37,484.08
买卖股票差价收入	-198,133.03	-871,408.32

#### 7.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	-	6,597.61
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-	34,217.81

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	-	40,815.42

#### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	2,635,308.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	2,563,670.93
减：应计利息总额	-	37,416.60
减：交易费用	-	2.76
买卖债券差价收入	-	34,217.81

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
股票投资产生的股利收益	10,738.95	5,627.67
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	10,738.95	5,627.67

### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	575,713.28	-749,308.23
——股票投资	575,713.28	-713,288.06
——债券投资	-	-36,020.17
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	575,713.28	-749,308.23

### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	7,675.15	29,542.45
转换费收入	25.23	3.05
合计	7,700.38	29,545.50

### 7.4.7.17 信用减值损失

无。

### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	-5,082.41	-
信息披露费	-	-
合计	-5,082.41	-

## 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2023年12月31日，本基金不存在应披露未披露的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金不存在应披露未披露的重大承诺事项。

## 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、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行股份有限公司("华夏银行")	基金托管人、基金销售机构
联合创业集团有限公司	基金管理人股东
大连亚联投资管理有限公司	基金管理人股东
北京鹏康投资有限公司	基金管理人股东
北京指南针科技发展股份有限公司	基金管理人股东
深圳大华信安私募证券投资基金管理企业(有限合伙)	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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

#### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	51,658.76	50,456.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,888.88	22,367.37
应支付基金管理人的净管理费	28,769.88	28,088.98

注1：支付基金管理人的管理人报酬年费率为1.20%，逐日计提，按月支付。日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%÷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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,304.84	4,204.75

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售	本期



服务费的各关联方名称	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	先锋聚利A	先锋聚利C	合计
先锋基金	0.00	343.74	343.74
华夏银行	0.00	244.55	244.55
合计	0.00	588.29	588.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
先锋聚利A	先锋聚利C	合计	
先锋基金	0.00	370.21	370.21
华夏银行	0.00	274.79	274.79
合计	0.00	645.00	645.00

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。C类份额的销售服务费率为年费率0.2%。支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给先锋基金，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：C类日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.2%/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**

无。

**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	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022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
华夏银行股份有限公司	1,565,190.24	3,653.61	390,865.99	1,550.46

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管，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

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。

#### 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--固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

#### 7.4.12 期末（2023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

无。

###### 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

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基

金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险，并设定适当的投资限额，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成：第一层次为董事会、风险控制委员会所领导；第二层次为总经理、督察长、风险管理委员会、监察稽核部所监控；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

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

#### **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的发行人出现违约、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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行华夏银行股份有限公司，与该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，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。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示。如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有以上相应投资。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 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于开放期内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。

截至2023年12月31日止，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个半月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）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。

#### 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》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，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理

人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金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15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

#### 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,565,190.24	-	-	-	1,565,190.24
结算备付金	9,434.76	-	-	-	9,434.76
存出保证金	5,552.37	-	-	-	5,552.37
交易性金融资产	-	-	-	1,973,611.37	1,973,611.37
买入返售金融资产	507,000.00	-	-	-	507,000.00
应收申购款	-	-	-	500.00	500.00
资产总计	2,087,177.37	-	-	1,974,111.37	4,061,288.74
负债					
应付清算款	-	-	-	608,217.33	608,217.33
应付赎回款	-	-	-	19,711.84	19,711.84
应付管理人报酬	-	-	-	3,455.02	3,455.02
应付托管费	-	-	-	287.93	287.93
应付销售服务费	-	-	-	237.67	237.67
其他负债	-	-	-	40,962.76	40,962.76
负债总计	-	-	-	672,872.55	672,872.55

计					
利率敏 感度缺 口	2,087,177.37	-	-	1,301,238.82	3,388,416.19
上年度 末 2022年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	390,865.99	-	-	-	390,865.99
结算备 付金	12,106.03	-	-	-	12,106.03
存出保 证金	8,532.87	-	-	-	8,532.87
交易性 金融资 产	-	-	-	4,611,312.54	4,611,312.54
应收申 购款	-	-	-	1,472.65	1,472.65
资产总 计	411,504.89	-	-	4,612,785.19	5,024,290.08
负债					
应付赎 回款	-	-	-	1,095.31	1,095.31
应付管 理人报 酬	-	-	-	5,033.93	5,033.93
应付托 管费	-	-	-	419.51	419.51
应付销 售服务 费	-	-	-	333.38	333.38
其他负 债	-	-	-	47,106.83	47,106.83
负债总 计	-	-	-	53,988.96	53,988.96

计					
利率敏 感度缺 口	411,504.89	-	-	4,558,796.23	4,970,301.12

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金管理人通过采用双线并行的投资组合策略，自上而下地进行证券品种的资产配置，自下而上地精选股票。结合宏观及微观环境的变化，定期或不定期对投资策略、资产配置、基金资产投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例范围为0-95%，每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净



		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,973,611.37	58.25	4,611,312.54	92.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,973,611.37	58.25	4,611,312.54	92.78

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	沪深300指数上涨5%	115,501.71	88,326.30
	沪深300指数下跌5%	-115,501.71	-88,326.30

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

**7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**

**7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	1,973,611.37	4,611,312.54
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,973,611.37	4,611,312.54

**7.4.14.2.2 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

无。

**7.4.14.4 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。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

**§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	权益投资	1,973,611.37	48.60
	其中：股票	1,973,611.37	48.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	507,000.00	12.48
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,574,625.00	38.77
8	其他各项资产	6,052.37	0.15
9	合计	4,061,288.74	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,808,336.81	53.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,590.56	1.94
J	金融业	99,684.00	2.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,973,611.37	58.25

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603893	瑞芯微	5,000	317,000.00	9.36
2	002415	海康威视	7,600	263,872.00	7.79
3	688157	松井股份	3,938	212,415.72	6.27
4	688107	安路科技	5,352	196,846.56	5.81
5	301517	陕西华达	2,400	134,160.00	3.96
6	688522	纳睿雷达	2,374	131,733.26	3.89
7	603738	泰晶科技	7,700	125,895.00	3.72
8	688205	德科立	2,524	124,887.52	3.69
9	300458	全志科技	4,600	104,374.00	3.08
10	688209	英集芯	5,767	102,998.62	3.04
11	300059	东方财富	7,100	99,684.00	2.94
12	688416	恒烁股份	1,607	94,154.13	2.78
13	688031	星环科技	1,008	65,590.56	1.94

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比
----	------	------	----------	------------

				例(%)
1	688515	裕太微	570,911.38	11.49
2	603986	兆易创新	542,269.00	10.91
3	688798	艾为电子	415,691.39	8.36
4	603893	瑞芯微	383,812.00	7.72
5	688157	松井股份	366,191.67	7.37
6	688981	中芯国际	351,957.04	7.08
7	002415	海康威视	338,352.00	6.81
8	688209	英集芯	289,704.73	5.83
9	688220	翱捷科技	271,544.68	5.46
10	300782	卓胜微	268,268.00	5.40
11	688292	浩瀚深度	267,192.51	5.38
12	002790	瑞尔特	246,381.00	4.96
13	688150	莱特光电	241,715.47	4.86
14	301095	广立微	240,697.00	4.84
15	688668	鼎通科技	239,045.36	4.81
16	688018	乐鑫科技	237,162.44	4.77
17	688107	安路科技	231,705.42	4.66
18	300059	东方财富	226,664.00	4.56
19	002138	顺络电子	225,021.00	4.53
20	688110	东芯股份	219,962.13	4.43
21	601698	中国卫通	216,170.00	4.35
22	300188	国投智能	214,534.00	4.32
23	688502	茂莱光学	199,074.08	4.01
24	300895	铜牛信息	198,392.00	3.99
25	601728	中国电信	191,862.00	3.86
26	002179	中航光电	171,794.34	3.46
27	600563	法拉电子	171,507.00	3.45
28	688416	恒烁股份	165,514.19	3.33
29	688170	德龙激光	157,441.80	3.17
30	603666	亿嘉和	155,490.00	3.13

31	300408	三环集团	154,824.00	3.11
32	688183	生益电子	154,502.77	3.11
33	000858	五粮液	152,003.00	3.06
34	301517	陕西华达	151,731.00	3.05
35	002156	通富微电	151,288.00	3.04
36	688385	复旦微电	151,129.00	3.04
37	688205	德科立	150,005.08	3.02
38	603799	华友钴业	149,907.00	3.02
39	300398	飞凯材料	143,361.00	2.88
40	002460	赣锋锂业	143,044.00	2.88
41	002918	蒙娜丽莎	142,906.00	2.88
42	300432	富临精工	142,575.00	2.87
43	300772	运达股份	142,400.00	2.87
44	688116	天奈科技	140,907.90	2.83
45	000657	中钨高新	140,816.00	2.83
46	300373	扬杰科技	140,692.00	2.83
47	301329	信音电子	139,028.00	2.80
48	688489	三未信安	138,827.04	2.79
49	300769	德方纳米	138,800.00	2.79
50	603738	泰晶科技	138,267.00	2.78
51	688702	盛科通信	137,700.34	2.77
52	600233	圆通速递	137,658.00	2.77
53	300909	汇创达	137,483.00	2.77
54	300450	先导智能	136,793.00	2.75
55	603605	珀莱雅	135,959.00	2.74
56	301377	鼎泰高科	130,440.00	2.62
57	300124	汇川技术	127,960.00	2.57
58	301099	雅创电子	127,530.00	2.57
59	300593	新雷能	126,480.00	2.54
60	002240	盛新锂能	126,402.00	2.54
61	688202	美迪西	125,313.21	2.52

62	300073	当升科技	124,371.00	2.50
63	002935	天奥电子	123,361.00	2.48
64	688521	芯原股份	123,012.00	2.47
65	300308	中际旭创	122,316.00	2.46
66	688522	纳睿雷达	121,590.87	2.45
67	300793	佳禾智能	121,100.00	2.44
68	300502	新易盛	120,970.00	2.43
69	300458	全志科技	118,038.80	2.37
70	600439	瑞贝卡	116,800.00	2.35
71	689009	九号公司	115,039.32	2.31
72	000021	深科技	114,375.00	2.30
73	300568	星源材质	112,288.00	2.26
74	688435	英方软件	112,283.60	2.26
75	603068	博通集成	111,740.00	2.25
76	603005	晶方科技	111,281.00	2.24
77	688031	星环科技	109,904.76	2.21
78	002624	完美世界	109,844.00	2.21
79	001206	依依股份	109,748.00	2.21
80	300629	新劲刚	109,746.00	2.21
81	688776	国光电气	109,323.12	2.20
82	301270	汉仪股份	109,156.00	2.20
83	601236	红塔证券	108,725.00	2.19
84	688300	联瑞新材	108,627.81	2.19
85	301121	紫建电子	108,562.00	2.18
86	001283	豪鹏科技	107,936.00	2.17
87	002594	比亚迪	107,516.00	2.16
88	688058	宝兰德	107,341.64	2.16
89	688053	思科瑞	107,048.96	2.15
90	603296	华勤技术	106,125.00	2.14
91	688559	海目星	103,793.40	2.09
92	603995	甬金股份	102,723.00	2.07

93	688499	利元亨	102,692.46	2.07
94	688249	晶合集成	102,333.30	2.06
95	300511	雪榕生物	102,200.00	2.06

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603986	兆易创新	537,023.00	10.80
2	688515	裕太微	523,751.70	10.54
3	688798	艾为电子	402,670.25	8.10
4	688981	中芯国际	361,402.61	7.27
5	688220	翱捷科技	291,629.45	5.87
6	688668	鼎通科技	278,670.00	5.61
7	688292	浩瀚深度	268,648.32	5.41
8	688018	乐鑫科技	253,887.65	5.11
9	002790	瑞尔特	247,923.00	4.99
10	300593	新雷能	247,168.20	4.97
11	688202	美迪西	238,803.44	4.80
12	300895	铜牛信息	231,686.50	4.66
13	601698	中国卫通	227,745.00	4.58
14	603668	天马科技	227,134.20	4.57
15	688110	东芯股份	226,198.44	4.55
16	002459	晶澳科技	225,575.00	4.54
17	002138	顺络电子	223,883.00	4.50
18	300568	星源材质	222,166.00	4.47
19	300782	卓胜微	221,250.00	4.45
20	300188	国投智能	213,296.00	4.29



21	688150	莱特光电	212,023.33	4.27
22	301095	广立微	210,102.00	4.23
23	002594	比亚迪	206,100.00	4.15
24	688502	茂莱光学	203,640.53	4.10
25	601728	中国电信	199,898.00	4.02
26	688559	海目星	198,175.73	3.99
27	688499	利元亨	196,567.99	3.95
28	688209	英集芯	196,248.91	3.95
29	002049	紫光国微	193,040.00	3.88
30	688157	松井股份	192,419.94	3.87
31	600563	法拉电子	187,549.00	3.77
32	688032	禾迈股份	187,284.00	3.77
33	002179	中航光电	173,411.00	3.49
34	000858	五粮液	163,248.00	3.28
35	002156	通富微电	163,079.00	3.28
36	603799	华友钴业	160,775.00	3.23
37	688183	生益电子	157,153.14	3.16
38	300408	三环集团	153,621.00	3.09
39	688385	复旦微电	151,944.26	3.06
40	688170	德龙激光	151,495.20	3.05
41	300398	飞凯材料	149,939.00	3.02
42	300450	先导智能	149,022.00	3.00
43	600233	圆通速递	147,429.00	2.97
44	300373	扬杰科技	147,355.00	2.96
45	002460	赣锋锂业	146,158.00	2.94
46	002918	蒙娜丽莎	146,115.00	2.94
47	300432	富临精工	144,590.00	2.91
48	300909	汇创达	144,487.00	2.91
49	301329	信音电子	142,977.00	2.88
50	300769	德方纳米	142,318.00	2.86
51	688116	天奈科技	141,124.16	2.84

52	000657	中钨高新	140,494.00	2.83
53	600129	太极集团	140,238.00	2.82
54	002965	祥鑫科技	139,542.00	2.81
55	300772	运达股份	138,403.00	2.78
56	688702	盛科通信	138,043.57	2.78
57	688390	固德威	137,802.11	2.77
58	300910	瑞丰新材	136,688.00	2.75
59	688489	三未信安	136,600.96	2.75
60	603666	亿嘉和	135,388.00	2.72
61	002240	盛新锂能	135,104.00	2.72
62	301377	鼎泰高科	134,450.00	2.71
63	603605	珀莱雅	134,052.00	2.70
64	300124	汇川技术	133,864.00	2.69
65	603236	移远通信	133,842.00	2.69
66	300073	当升科技	132,617.00	2.67
67	300438	鹏辉能源	132,604.00	2.67
68	300502	新易盛	129,195.00	2.60
69	000021	深科技	129,160.00	2.60
70	301099	雅创电子	128,672.00	2.59
71	002518	科士达	128,079.00	2.58
72	301165	锐捷网络	126,468.00	2.54
73	603596	伯特利	125,925.00	2.53
74	688521	芯原股份	125,434.31	2.52
75	688676	金盘科技	125,146.97	2.52
76	002487	大金重工	124,967.00	2.51
77	300308	中际旭创	124,694.00	2.51
78	688778	厦钨新能	122,767.00	2.47
79	300693	盛弘股份	122,754.00	2.47
80	688063	派能科技	121,466.36	2.44
81	688560	明冠新材	120,538.68	2.43
82	300101	振芯科技	119,462.00	2.40

83	688518	联赢激光	119,433.69	2.40
84	002126	银轮股份	119,170.00	2.40
85	688008	澜起科技	118,406.08	2.38
86	600439	瑞贝卡	117,200.00	2.36
87	001283	豪鹏科技	116,838.00	2.35
88	300629	新劲刚	116,156.00	2.34
89	002935	天奥电子	115,902.00	2.33
90	002865	钧达股份	115,316.00	2.32
91	301096	百诚医药	114,368.00	2.30
92	600699	均胜电子	114,114.00	2.30
93	603688	石英股份	114,000.00	2.29
94	301270	汉仪股份	113,619.00	2.29
95	688300	联瑞新材	113,572.82	2.29
96	301050	雷电微力	113,414.00	2.28
97	688800	瑞可达	112,568.48	2.26
98	002139	拓邦股份	112,506.00	2.26
99	688058	宝兰德	112,400.00	2.26
100	688048	长光华芯	112,343.34	2.26
101	603296	华勤技术	112,065.00	2.25
102	688658	悦康药业	111,667.30	2.25
103	688596	正帆科技	111,605.12	2.25
104	603728	鸣志电器	111,592.00	2.25
105	603613	国联股份	111,240.60	2.24
106	689009	九号公司	110,965.44	2.23
107	002624	完美世界	110,336.00	2.22
108	688131	皓元医药	110,250.00	2.22
109	688776	国光电气	109,837.23	2.21
110	300793	佳禾智能	109,463.00	2.20
111	601236	红塔证券	109,318.00	2.20
112	603068	博通集成	108,369.00	2.18
113	688053	思科瑞	108,077.40	2.17

114	605117	德业股份	106,355.00	2.14
115	001206	依依股份	105,856.00	2.13
116	603005	晶方科技	104,932.00	2.11
117	688392	骄成超声	104,400.00	2.10
118	001309	德明利	103,500.00	2.08
119	688249	晶集成成	103,436.48	2.08
120	300059	东方财富	100,450.00	2.02

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	19,387,235.72
卖出股票收入（成交）总额	22,452,054.09

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂不参与股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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

**8.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，未发生投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票的情形。**

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,552.37
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,052.37

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末未持有流通受限股票。

### 8.12.6 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

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
先锋聚利A	362	6,634.59	0.00	0.00%	2,401,722.16	100.00%
先锋聚利C	657	2,669.80	0.00	0.00%	1,754,059.99	100.00%
合计	1,019	4,078.29	0.00	0.00%	4,155,782.15	100.00%

### 9.2 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	先锋聚利A	1,173.29	0.0489%
	先锋聚利C	9,138.94	0.5210%
	合计	10,312.23	0.2481%

### 9.3 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	先锋聚利A	0
	先锋聚利C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基	先锋聚利A	0~10

金	先锋聚利C	0~10
	合计	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	先锋聚利A	先锋聚利C
基金合同生效日(2018年05月09日)基金份额总额	92,204.17	208,331,123.95
本报告期期初基金份额总额	3,753,583.00	2,624,557.43
本报告期基金总申购份额	483,371.87	2,678,274.55
减：本报告期基金总赎回份额	1,835,232.71	3,548,771.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,401,722.16	1,754,059.99

## §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份额持有人大会。

### 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

本基金管理人本报告期内重大人事变动：

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

本基金托管人本报告期内重大人事变动：

本报告期内，本基金托管人2023年2月23日发布公告，胡捷先生自2023年2月23日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人2023年4月7日发布公告，朱绍纲先生自2023年4月4日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人2023年7月3日发布公告，郑鹏先生自2023年5月16日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部风险总监。

本报告期内，本基金托管人2023年7月27日发布公告，国然女士自2023年7月18日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

### 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

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

本基金本年度应支付的审计费用为人民币3,000.00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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，公司财务指标存在不符合《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》相关规定的情形，中国监督管理委员会北京监管局要求公司限期改善财务状况。本报告期内，公司已完成大股东股权拍卖事项，待取得中国证券监督管理委员会核准之后，股东将立即对公司进行增资以改善公司财务指标，确保符合规定。

#### 11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
华泰证券	2	16,565,336.61	39.59%	6,979.44	27.41%	-
天风证券	2	25,273,953.20	60.41%	18,479.96	72.59%	-



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。

### 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
华泰证券	-	-	6,000,000.00	4.81%	-	-	-	-
天风证券	-	-	118,658,000.00	95.19%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	先锋基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-11
2	先锋基金管理有限公司关于先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理变更	上海证券报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-13

	公告		
3	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-17
4	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金2022年第四季度报告	基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-19
5	先锋基金管理有限公司关于董事长（法定代表人）变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-20
6	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-20
7	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-01-20
8	先锋基金管理有限公司关于北京办公地址变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-03-21
9	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023年第1号）	基金管理人网站、证监会指定网站	2023-03-23
10	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站、证监会指定网站	2023-03-23
11	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金2022年年度报告	基金管理人网站、证监会指定网站	2023-03-31
12	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金2023年第1季度	基金管理人网站、证监会指定网站	2023-04-21

	报告		
13	关于先锋基金管理有限公司董事、监事变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-05-08
14	先锋基金管理有限公司关于终止吉林九台农村商业银行股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-05-16
15	先锋基金管理有限公司2023年基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-05-23
16	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-05-30
17	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金2023年第2季度报告	基金管理人网站、证监会指定网站	2023-07-21
18	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-08-19
19	先锋基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益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	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-08-30
20	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金2023年中期报告	基金管理人网站、证监会指定网站	2023-08-31
21	先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金2023年第3季度	基金管理人网站、证监会指定网站	2023-10-25

	报告		
22	先锋基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份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、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-12-01
23	先锋基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧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、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023-12-08

## §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
个人	1	20230109-20230606;20230614-20231231	1,252,284.60	0.00	0.00	1,252,284.60	30.1335%
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 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。</p> <p>(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。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

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

2023年8月19日，基金管理人在中国证监会规定媒体及规定网站刊登了《关于高级管理人员变更的公告》，具体内容详见公告。

## §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聚利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

13.1.2 《先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

13.1.3 《先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.1.5 报告期内先锋聚利灵活配置混合型证券投资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  
二〇二四年三月二十九日