先锋日添利货币市场基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

基金管理人:先锋基金管理有限公司
基金托管人:渤海银行股份有限公司
送出日期:2019年08月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	先锋日添利货币市场基金	
基金简称	先锋日添利	
基金主代码	004151	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年04月14日	
基金管理人	先锋基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	265,772,574.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	先锋日添利A	先锋日添利B
下属分级基金的交易代码	004151	004152
报告期末下属分级基金的份额总额	17,345,039.48份	248,427,534.85份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		先锋基金管理有限公司	渤海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	欧阳晓辉	阮劲松
	联系电话	010-58239830	010-65110109
	电子邮箱	ouyangxh@xf-fund.com	js.ruan@cbhb.com.cn
客户服务电话		400-815-9998	4008888811/95541
传真		010-58239896	022-58314791
注册地址		深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室	天津市河东区海河东路218号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座24层	天津市河东区海河东路218号
邮政编码		100088	300012
法定代表人		张松孝	李伏安

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	先锋日添利A	先锋日添利B
本期已实现收益	288,740.19	10,746,204.93
本期利润	288,740.19	10,746,204.93
本期净值收益率	1.1322%	1.2532%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末基金资产净值	17,345,039.48	248,427,534.85
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
累计净值收益率	7.5918%	8.1686%

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

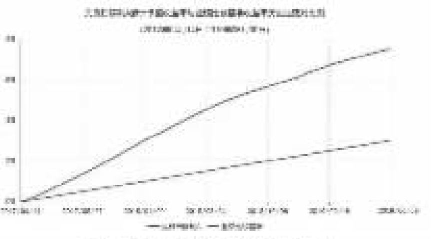
先锋日添利A

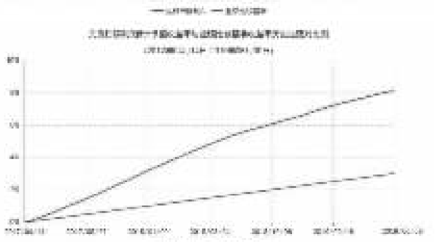
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1628%	0.0009%	0.1125%	0.0000%	0.0503%	0.0009%
过去三个月	0.5110%	0.0007%	0.3413%	0.0000%	0.1697%	0.0007%
过去六个月	1.1322%	0.0012%	0.6788%	0.0000%	0.4534%	0.0012%
过去一年	2.5131%	0.0019%	1.3688%	0.0000%	1.1443%	0.0019%
自基金合同生效起至今	7.5918%	0.0029%	3.0300%	0.0000%	4.5618%	0.0029%

先锋日添利B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1827%	0.0009%	0.1125%	0.0000%	0.0702%	0.0009%
过去三个月	0.5714%	0.0007%	0.3413%	0.0000%	0.2301%	0.0007%
过去六个月	1.2532%	0.0012%	0.6788%	0.0000%	0.5744%	0.0012%
过去一年	2.7606%	0.0019%	1.3688%	0.0000%	1.3918%	0.0019%
自基金合同生效起至今	8.1686%	0.0029%	3.0300%	0.0000%	5.1386%	0.0029%

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。

§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%,大连先锋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%,齐靠民占注册资本的4.99%,张松孝占注册资本的4.99%。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及先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金8只开放式基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜磊	基金经理	2017-04-21	-	7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遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度宏观经济和金融市场波动加剧,经济阶段性回升在4月达到年内高位,货币政策4月份边际收紧,货币政策的刺激力度适度减弱,结合经济和通胀预期升温推动中长期债券收益率快速上行。5月中美经贸谈判再生波澜,财政支出放缓,叠加中小银行打破刚兑事件导致流动性分层,市场风险偏好收缩。央行于5月6日对中小银行实行较低存款准备金率,释放长期资金约2800亿元。进入6月,流动性分层加剧,具体体现为金融体系对于风险的重新定价,信用利差快速扩大,流动性变现压力加剧,风险偏好加速收缩。央行和金融监管部门开始对资金面极度关注,央行在公开市场操作表述中也频频提及"维护半年末流动性平稳",积极应对疏导小银行、非银机构流动性紧张局面和平息市场恐慌情绪,流动性分层边际上有所缓和,资金面平稳跨季,债券市场维持观望格局。G20中美元首会晤也传达了中性偏暖的信号,贸易摩擦出现阶段性缓和。

报告期内,本基金接受了严峻的考核,规模也进一步探底。流动性管理仍为第一要务,密切关注持有人占比和申赎资金动向,顺利地实现了半年末时点流动性的平稳过渡,并为投资者获得了稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末先锋日添利A基金份额净值为1.0000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为1.1322%,同期业绩比较基准收益率为0.6788%;截至报告期末先锋日添利B基金份额净值为1.0000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为1.2532%,同期业绩比较基准收益率为0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年,在经济基本面方面,预计实际经济增长有望稳中有降,但是压力不大;而通胀高点已过,预计三季度将面临显著的下行压力。经济增长弱稳定叠加通胀率回落的组合显示名义增速在三季度将会出现回落。而在经济调结构的政策背景下,只要实际经济增速和房地产投资不出现大幅下行,当前出现超预期刺激宽松信号的概率较低。因此,预计三季度利率将会出现下行,但波动幅度可能有限。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:先锋日添利货币市场基金

报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	622,840.38	80,390,083.14
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	209,583,066.84	1,065,768,011.41
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	209,583,066.84	1,065,768,011.41
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	56,000,324.00	398,334,618.70
应收证券清算款	-	-
应收利息	40,948.19	2,510,015.19
应收股利	-	-
应收申购款	-	85,288.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	266,247,179.41	1,547,088,016.44
负债和所有者权益	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	103,486.18	302,630.10
应付托管费	16,169.73	47,285.95
应付销售服务费	7,141.81	15,947.45
应付交易费用	29,346.38	31,746.71
应交税费	-	14,458.74
应付利息	-	-
应付利润	15,939.03	158,053.00
递延所得税负债	-	-
其他负债	302,521.95	199,000.00
负债合计	474,605.08	769,121.95
所有者权益:		
实收基金	265,772,574.33	1,546,318,894.49
未分配利润	-	-
所有者权益合计	265,772,574.33	1,546,318,894.49
负债和所有者权益总计	266,247,179.41	1,547,079,016.44

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额265,772,574.33份,其中A类基金份额总额17,345,039.48份,基金份额净值1.0000元;B类基金份额总额248,427,534.85份,基金份额净值1.0000元。

6.2 利润表

会计主体:先锋日添利货币市场基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		13,088,790.32	61,638,734.49
1.利息收入		12,932,994.73	60,713,843.90
其中:存款利息收入	6.4.3.9	648,371.16	16,110,351.81
债券利息收入		9,363,246.50	26,074,994.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,921,377.07	18,528,497.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		155,795.59	924,890.59
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.10	155,795.59	924,890.59
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以"—"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		2,053,845.20	7,477,502.29
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,379,033.68	4,162,516.99
2. 托管费	6.4.6.2.2	215,474.06	650,393.25
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	73,279.38	465,013.56
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		237,063.23	2,075,054.30
其中:卖出回购金融资产支出		237,063.23	2,075,054.30
6. 税金及附加		26,872.90	2,779.53
7. 其他费用	6.4.3.11	122,121.95	121,744.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		11,034,945.12	54,161,232.20
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		11,034,945.12	54,161,232.20

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:先锋日添利货币市场基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,546,318,894.49	-	1,546,318,894.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,034,945.12	11,034,945.12
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)	-1,280,546,320.16	-	-1,280,546,320.16
其中:1.基金申购款	2,187,085,700.41	-	2,187,085,700.41
2.基金赎回款	-3,467,632,020.57	-	-3,467,632,020.57
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)	-	-11,034,945.12	-11,034,945.12
五、期末所有者权益(基金净值)	265,772,574.33	-	265,772,574.33
项目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,323,558,850.42	-	3,323,558,850.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	54,161,232.20	54,161,232.20
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)	-1,716,991,024.74	-	-1,716,991,024.74
其中:1.基金申购款	8,214,865,825.14	-	8,214,865,825.14
2.基金赎回款	-9,931,856,849.88	-	-9,931,856,849.88
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)	-	-54,161,232.20	-54,161,232.20
五、期末所有者权益(基金净值)	1,606,567,825.68	-	1,606,567,825.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

- —————————— 基金管理人负责人:张松孝	- —————————— 主管会计工作负责人:张松孝	- —————————— 会计机构负责人:王汇琴

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

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

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

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

6.4.3 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
先锋基金管理有限公司("先锋基金")	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
渤海银行股份有限公司("渤海银行")	基金托管人
网信证券有限责任公司	基金管理人股东的子公司、基金销售机构
天津国美基金销售有限公司	该公司法定代表人为基金管理人董事、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,379,033.68	4,162,516.99
其中:支付销售机构的客户维护费	60,570.72	428,229.14

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0.32%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×0.32%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	215,474.06	650,393.25

注:支付基金托管人渤海银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.4.2.3 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 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	先锋日添利A	先锋日添利B	合计
先锋基金	16,497.70	38,341.18	54,838.88
网信证券	184.83	0.00	184.83
渤海银行	348.39	0.00	348.39
合计	17,030.92	38,341.18	55,372.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	先锋日添利A	先锋日添利B	合计
先锋基金	306,958.71	111,911.72	418,870.43
网信证券	198.12	56.76	254.88
渤海银行	3,180.21	46.93	3,227.14
天津国美	0.37	0.00	0.37
合计	310,337.41	112,015.41	422,352.82

注:支付基金销售机构的销售服务费A类按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,B类按前一日基金资产净值0.01%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给先锋基金,再由先锋基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

A类日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25%/ 当年天数。

B类日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.01%/ 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

先锋日添利A

份额单位:份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	3,411,525.74
报告期间因拆分变动份额	118,077.72	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	118,077.72	3,411,525.74
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.68%	3.84%

先锋日添利B

份额单位:份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
报告期初持有的基金份额	36,704,303.80	25,002,550.05
报告期间申购/买入总份额	30,000,000.00	45,661,625.88
报告期间因拆分变动份额	295,696.20	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	67,000,000.00	70,664,175.93
报告期末持有的基金份额	0.00%	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注:1.期间申购含红利再投份额。

2. 基金管理人先锋基金管理有限公司在本年度申购/赎回本基金的交易委托先锋基金直销中心办理,本基金不收取申购/赎回费用。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.4.5 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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渤海银行股份有限公司	622,840.38	7,657.22	967,020.56	17,080.52

注:本基金的银行存款由基金托管人渤海银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	209,583,066.84	78.72
	其中:债券	209,583,066.84	78.72
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	56,000,324.00	21.03
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	622,840.38	0.23
4	其他各项资产	40,948.19	0.02
5	合计	266,247,179.41	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.11	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

无。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	27
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	45
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	16

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限没有超过120天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	58.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	37.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	3.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.16	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期没有超过240天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,864,635.58	18.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,000,133.41	3.76
6	中期票据	-	-
7	同业存单	149,718,297.85	56.33
8	其他	-	-
9	合计	209,583,066.84	78.86
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	111909139	19浦发银行CD139	500,000	49,831,505.60	18.75
2	111880582	18南京银行CD086	400,000	39,978,209.66	15.04
3	199918	19贴现国债18	300,000	29,925,345.35	11.26
4	111811289	18平安银行CD289	200,000	19,974,123.18	7.52
5	111903080	19农业银行CD080	200,000	19,970,168.86	7.51
6	111815553	18民生银行CD553	200,000	19,964,290.55	7.51
7	199920	19贴现国债20	200,000	19,939,290.23	7.50
8	071900053	19招商CP006	100,000	10,000,133.41	3.76

7.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0788%
报告期内偏离度的最低值	-0.0081%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0269%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.0000元。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.9.3 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	40,948.19
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	40,948.19

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
先锋日添利A	7,415	2,339.18	7,868,221.52	45.36%	9,476,817.96	54.64%
先锋日添利B	7	35,489,647.84	248,427,534.85	100.00%	0.00	0.00%
合计	7,422	35,808.75	256,295,756.37	96.43%	9,476,817.96	3.57%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	信托类机构	70,004,387.57	26.34%
2	券商类机构	61,240,689.27	23.05%
3	券商类机构	35,093,352.04	13.21%
4	券商类机构	21,967,565.21	8.27%
5	券商类机构	20,052,196.06	7.55%
6	基金类机构	20,036,790.58	7.54%
7	券商类机构	20,002,545.52	7.53%
8	企业类机构	2,104,719.69	0.79%
9	企业类机构	1,368,067.03	0.51%
10	基金类机构	1,047,768.42	0.39%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	先锋日添利A	7,601.07	0.00%
	先锋日添利B	-	-
	合计	7,601.07	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	先锋日添利A	-
	先锋日添利B	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	先锋日添利A	-
	先锋日添利B	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	先锋日添利A	先锋日添利B
基金合同生效日(2017年04月14日)基金份额总额	230,239,341.61	161,007,444.44
本报告期期初基金份额总额	39,800,036.26	1,506,518,858.23
本报告期基金总申购份额	22,383,200.02	2,164,702,500.39
减:本报告期基金总赎回份额	44,838,196.80	3,422,793,823.77
本报告期期末基金份额总额	17,345,039.48	248,427,534.85

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人本报告期内重大人事变动:

高级管理人员变更:2019年2月27日,本公司发布公告,自2019年2月20日起聘任马晓昕先生为先锋基金管理有限公司副总经理。

代任高级管理人员:2019年3月5日,本公司发布公告,张松孝先生自2019年3月1日起代任先锋基金管理有限公司总经理。

离任高级管理人员:2019年3月5日,本公司发布公告,齐靠民先生因任期届满自2019年2月28日起离任先锋基金管理有限公司总经理。

高级管理人员变更:2019年7月3日,本公司发布公告,自2019年6月26日起聘任刘岩先生为先锋基金管理有限公司首席信息官。

离任高级管理人员:2019年7月3日,本公司发布公告,王致远先生因任期届满自2019年6月26日起离任先锋基金管理有限公司督察长。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
万联证券	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下:

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
万联证券	-	-	411,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在0.5%(含)以上的情况。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190107-20190304 20190306-20190307 20190312-20190324	268,709,855.85	1,905,654.40	270,615,510.25	0.00	0.00%
	2	20190108-20190226 20190312-20190623	250,640,512.85	2,992,704.80	253,633,217.65	0.00	0.00%
	3	20190613-20190630	60,468,715.12	771,974.15	0.00	61,240,689.27	23.04%
	4	20190627-20160630	0.00	70,004,387.57	0.00	70,004,387.57	26.34%
产品特有风险							
(1)特定投资者大额赎回导致的流动性风险 如果特定投资者大额赎回,为应对赎回,可能迫使基金以不适当的价格大量抛售证券,使基金的净值增长率受到不利影响。 (2)特定投资者大额赎回导致的巨额赎回风险 如果特定投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请。 (3)特定投资者大额赎回导致的基金资产净值较低的风险 如果特定投资者大额赎回导致基金资产净值较低,可能出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,继而触发基金合同终止条件导致基金无法继续存续。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

先锋基金管理有限公司
二〇一九年八月二十三日