

# 先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:先锋基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年6月30日。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| §4 管理人报告                                | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11 |
| 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       | 11 |
| §5 托管人报告                                | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 12 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)                       | 12 |
| 6.1 资产负债表                               | 12 |
| 6.2 利润表                                 | 14 |
| 6.3 净资产(基金净值)变动表                        | 16 |
| 6.4 报表附注                                | 18 |
| §7 投资组合报告                               | 46 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 46 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 47 |
| 7.3 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       | 48 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 49 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 53 |
| 7.6 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      | 53 |
| 7.7 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   | 53 |
| 7.8 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   | 53 |
| 7.9 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      | 54 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 54 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 54 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 55 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 55 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 55 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况        | 55 |

|  |    |
|--|----|
| §9 开放式基金份额变动 .....                       | 56 |
| §10 重大事件揭示 .....                         | 56 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 56 |
| 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 .....   | 56 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 57 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 57 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 57 |
| 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 .....      | 57 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 57 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 58 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 59 |
| 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 ..... | 59 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 59 |
| §12 备查文件目录 .....                         | 60 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 60 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 60 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 60 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |               |
|-----------------|-------------------|---------------|
| 基金名称            | 先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金 |               |
| 基金简称            | 先锋聚优              |               |
| 基金主代码           | 004726            |               |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |               |
| 基金合同生效日         | 2017年09月15日       |               |
| 基金管理人           | 先锋基金管理有限公司        |               |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司        |               |
| 报告期末基金份额总额      | 3,453,032.20份     |               |
| 基金合同存续期         | 不定期               |               |
| 下属分级基金的基金简称     | 先锋聚优A             | 先锋聚优C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 004726            | 004727        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 913,825.05份       | 2,539,207.15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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露 姓名 | 徐文         | 陆志俊        |

|        |      |   |                       |
|--------|------|---|-----------------------|
| 露负责人   | 联系电话 | 400-815-9998                              | 95559                 |
|        | 电子邮箱 | xuw@xf-fund.com                           | luzj@bankcomm.com     |
| 客户服务电话 |      | 400-815-9998                              | 95559                 |
| 传真     |      | 010-58239896                              | 021-62701216          |
| 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 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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                   | 中国（上海）长宁区仙霞路18号       |
| 邮政编码   |      | 100088                                    | 200336                |
| 法定代表人  |      | 张松孝                                       | 任德奇                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报  |
| 登载基金中期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> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                    |
|--------|------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 先锋基金管理有限公司 | 北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座24层 |

## § 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                       |       |
|---------------|---------------------------|-------|
|               | (2022年01月01日-2022年06月30日) |       |
|               | 先锋聚优A                     | 先锋聚优C |
|               |                           |       |

|                      |                       |              |
|----------------------|-----------------------|--------------|
| 本期已实现收益              | -202,138.17           | -520,957.73  |
| 本期利润                 | 32,914.82             | -134,342.15  |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0400                | -0.0708      |
| 本期加权平均净值利润率          | 3.29%                 | -5.69%       |
| 本期基金份额净值增长率          | 9.27%                 | 9.17%        |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末<br>(2022年06月30日) |              |
| 期末可供分配利润             | 353,469.61            | 1,068,806.01 |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.3868                | 0.4209       |
| 期末基金资产净值             | 1,267,294.66          | 3,608,013.16 |
| 期末基金份额净值             | 1.3868                | 1.4209       |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末<br>(2022年06月30日) |              |
| 基金份额累计净值增长率          | 38.68%                | 42.09%       |

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

先锋聚优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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 21.36%   | 1.92%       | 5.19%      | 0.59%         | 16.17% | 1.33% |
| 过去三个月 | 12.51%   | 2.26%       | 3.96%      | 0.78%         | 8.55%  | 1.48% |
| 过去六个月 | 9.27%    | 1.93%       | -4.23%     | 0.80%         | 13.50% | 1.13% |
| 过去一年  | 9.55%    | 1.52%       | -5.51%     | 0.69%         | 15.06% | 0.83% |

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三年       | 94.31% | 1.48% | 17.42% | 0.69% | 76.89% | 0.79% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.68% | 1.34% | 23.98% | 0.70% | 14.70% | 0.64% |

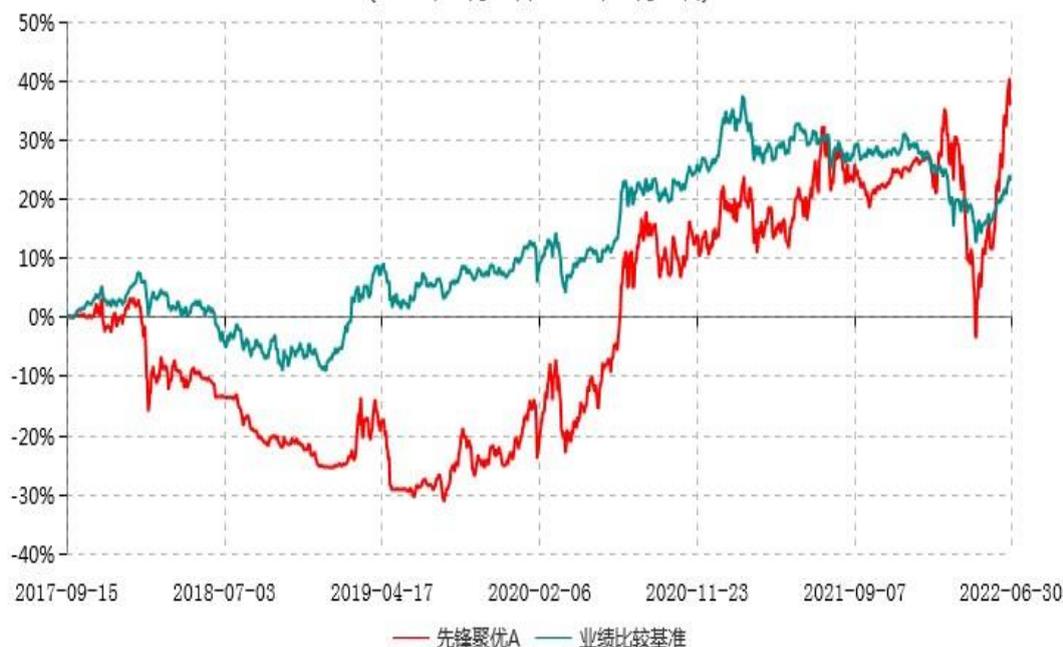
先锋聚优C

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 21.34%   | 1.92%       | 5.19%      | 0.59%         | 16.15% | 1.33% |
| 过去三个月      | 12.46%   | 2.26%       | 3.96%      | 0.78%         | 8.50%  | 1.48% |
| 过去六个月      | 9.17%    | 1.93%       | -4.23%     | 0.80%         | 13.40% | 1.13% |
| 过去一年       | 9.33%    | 1.52%       | -5.51%     | 0.69%         | 14.84% | 0.83% |
| 过去三年       | 92.98%   | 1.48%       | 17.42%     | 0.69%         | 75.56% | 0.79% |
| 自基金合同生效起至今 | 42.09%   | 1.34%       | 23.98%     | 0.70%         | 18.11% | 0.64% |

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

先锋聚优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

(2017年09月15日-2022年06月30日)



先锋聚优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  
(2017年09月15日-2022年06月30日)



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关于“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1.55亿元人民币。其中，联合创业集团有限公司占注册资本的33.1041%，大连亚联投资管理有限公司占注册资本的33.1039%，北京鹏康投资有限公司占注册资本的21.7790%，张松孝占注册资本的4.9904%，深圳市大华信安资产管理企业（有限合伙）占注册资本的4.8290%，深圳市瑞智源投资合伙企业（有限合伙）占注册资本的2.1936%。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<br>(助理) 期限 |          | 证券从<br>业年限 | 说明   |
|-----|------|----------------------|----------|------------|--|
|     |      | 任职日期                 | 离任日<br>期 |            |  |
| 孙欣炎 | 基金经理 | 2021-09-10           | -        | 7年         | 工科硕士, 2015年毕业于华东理工大学, 现任公司投资管理部权益总监、基金经理。2015年至2019年先后任新华基金研究部研究员、投资助理, 华泰保险资产管理部投资经理, 2019年9月加入本先锋基金。 |

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 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

上半年, 全球经济增速预期下修, 各国经济周期分化、普遍面临滞胀甚至衰退的风险挑战。外部环境叠加3月以来我国部分重点城市疫情规模性反弹的不利情况, 中国经济表现出了较大压力, 导致上半年经济增速与年初既定的目标差距显著。但是, 中国经济也显示出越是困难越向前的坚韧, 政府出台了一揽子稳住经济大盘的政策措施, 我们认为, 这些政策措施针对性强、力度大、持续性好, 政策效果已初步显现。

报告期内，本基金维持了较为稳健的投资策略，对于景气度向上的行业进行了重点配置，以取得性价比较高的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末先锋聚优A基金份额净值为1.3868元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.27%，同期业绩比较基准收益率为-4.23%；截至报告期末先锋聚优C基金份额净值为1.4209元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.17%，同期业绩比较基准收益率为-4.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，随着各项政策逐步落实，常态化核酸检测的铺开，疫情防控与经济增长之间的统筹将会做得更好，一揽子稳增长政策将充分释放出效果。随着积极有利因素逐渐增多，中国经济下半年将会急起直追，努力把上半年的经济损失尽可能地补回来，我们预计，二季度是年内经济低点，下半年经济将拾级而上，三、四季度单季经济增速水平将重回强势，全年仍有望实现一个在全球范围看相对合理较高的增速水平。

从中长期视角来看，证券市场目前估值处于合适区间，对未来保持积极乐观。继续关注景气度向上的科技类、高端制造等行业，同时也关注受益于经济复苏的大消费行业。

#### 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

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 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

自2017年10月19日起至本报告期末（2022年06月30日），本基金的基金资产净值存在连续六十个工作日低于5000万元的情形，至本报告期期末（2022年06月30日）基金资产净值仍低于5000万元。

本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

## § 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，基金托管人在先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，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

本报告期，先锋基金管理有限公司在先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由先锋基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

| 资产   | 附注号     | 本期末<br>2022年06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产：  |         |                    |                     |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 455,103.89         | 178,468.93          |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金         |            | 14,389.91                  | 6,865.28                    |
| 存出保证金         |            | 3,300.07                   | 1,414.50                    |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 4,597,358.39               | 2,052,665.00                |
| 其中：股票投资       |            | 4,597,358.39               | -                           |
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | -                          | 2,052,665.00                |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资         |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                          | -                           |
| 债权投资          |            | -                          | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                          | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | -                          | 238,913.62                  |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 29,541.06                  | 1,128.64                    |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          |            | -                          | 24,278.08                   |
| 资产总计          |            | 5,099,693.32               | 2,503,734.05                |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021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        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |

|             |         |              |              |
|-------------|---------|--------------|--------------|
| 卖出回购金融资产款   |         | -            | -            |
| 应付清算款       |         | 164,736.99   | -            |
| 应付赎回款       |         | 38,524.67    | 1,868.24     |
| 应付管理人报酬     |         | 2,315.71     | 1,726.83     |
| 应付托管费       |         | 289.47       | 215.85       |
| 应付销售服务费     |         | 402.70       | 290.41       |
| 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        | 6.4.7.5 | 18,115.96    | 10,526.49    |
| 负债合计        |         | 224,385.50   | 14,627.82    |
| <b>净资产：</b> |         |              |              |
| 实收基金        | 6.4.7.6 | 3,453,032.20 | 1,928,715.15 |
| 其他综合收益      |         | -            | -            |
| 未分配利润       | 6.4.7.7 | 1,422,275.62 | 560,391.08   |
| 净资产合计       |         | 4,875,307.82 | 2,489,106.23 |
| 负债和净资产总计    |         | 5,099,693.32 | 2,503,734.05 |

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额3,453,032.20份，其中A类基金份额净值1.3868元，基金份额总额为913,825.05份；C类基金份额净值1.4209元，基金份额总额为2,539,207.15份。

## 6.2 利润表

会计主体：先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目        | 附注号     | 本期<br>2022年01月01日至<br>2022年06月30日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至202<br>1年06月30日 |
|-----------|---------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入   |         | -83,614.54                        | 283,100.83                             |
| 1. 利息收入   |         | 1,372.20                          | 1,310.19                               |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.8 | 1,372.20                          | 1,310.19                               |

|                   |            |             |               |
|-------------------|------------|-------------|---------------|
| 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        |            | -           | -             |
| 其他利息收入            |            | -           | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |            | -726,128.15 | 1,589,994.29  |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.9    | -766,955.70 | 1,580,855.68  |
| 基金投资收益            | 6.4.7.10   | -           | -             |
| 债券投资收益            | 6.4.7.11   | 33,243.38   | -             |
| 资产支持证券投资          | 6.4.7.12   | -           | -             |
| 收益                |            |             |               |
| 贵金属投资收益           |            | -           | -             |
| 衍生工具收益            | 6.4.7.13   | -           | -             |
| 股利收益              | 6.4.7.14   | 7,584.17    | 9,138.61      |
| 以摊余成本计量的          |            |             |               |
| 金融资产终止确认          |            |             |               |
| 产生的收益             |            | -           | -             |
| 其他投资收益            |            | -           | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损     | 6.4.7.15   | 621,668.57  | -1,320,222.72 |
| 失以“-”号填列）         |            |             |               |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”    |            |             |               |
| 号填列）              |            | -           | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”    | 6.4.7.16   | 19,472.84   | 12,019.07     |
| 号填列）              |            |             |               |
| <b>减：二、营业总支出</b>  |            | 17,812.79   | 39,606.66     |
| 1. 管理人报酬          | 6.4.10.2.1 | 13,189.05   | 10,111.84     |
| 2. 托管费            | 6.4.10.2.2 | 1,648.65    | 1,264.03      |
| 3. 销售服务费          | 6.4.10.2.  | 2,312.37    | 1,188.39      |

|                     |          |             |            |
|---------------------|----------|-------------|------------|
|                     | 3        |             |            |
| 4. 投资顾问费            |          | -           | -          |
| 5. 利息支出             |          | -           | -          |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | -           | -          |
| 6. 信用减值损失           |          | -           | -          |
| 7. 税金及附加            |          | -           | -          |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.17 | 662.72      | 27,042.40  |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | -101,427.33 | 243,494.17 |
| 减：所得税费用             |          | -           | -          |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | -101,427.33 | 243,494.17 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -           | -          |
| 六、综合收益总额            |          | -101,427.33 | 243,494.17 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |        |            |              |
|-----------------|-------------------------------|--------|------------|--------------|
|                 | 实收基金                          | 其他综合收益 | 未分配利润      | 净资产合计        |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 1,928,715.15                  | -      | 560,391.08 | 2,489,106.23 |
| 加：会计政策变更        | -                             | -      | -          | -            |
| 前期差错更正          | -                             | -      | -          | -            |
| 其他              | -                             | -      | -          | -            |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 1,928,715.15                  | -      | 560,391.08 | 2,489,106.23 |

|  |                                    |        |              |               |
|--|------------------------------------|--------|--------------|---------------|
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | 1,524,317.05                       | -      | 861,884.54   | 2,386,201.59  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                  | -      | -101,427.33  | -101,427.33   |
| (二)、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)      | 1,524,317.05                       | -      | 963,311.87   | 2,487,628.92  |
| 其中:1.基金申购款                               | 5,834,347.62                       | -      | 1,891,158.22 | 7,725,505.84  |
| 2.基金赎回款                                  | -4,310,030.57                      | -      | -927,846.35  | -5,237,876.92 |
| (三)、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) | -                                  | -      | -            | -             |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                  | -      | -            | -             |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 3,453,032.20                       | -      | 1,422,275.62 | 4,875,307.82  |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |        |              |               |
|  | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润        | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 5,419,511.98                       | -      | 1,024,033.17 | 6,443,545.15  |
| 加:会计政策变更                                 | -                                  | -      | -            | -             |
| 前期差错更正                                   | -                                  | -      | -            | -             |
| 其他                                       | -                                  | -      | -            | -             |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 5,419,511.98                       | -      | 1,024,033.17 | 6,443,545.15  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -4,052,510.37                      | -      | -640,628.16  | -4,693,138.53 |

|  |               |   |               |               |
|--|---------------|---|---------------|---------------|
| （一）、综合收益总额                               | -             | - | 243,494.17    | 243,494.17    |
| （二）、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）      | -4,052,510.37 | - | -884,122.33   | -4,936,632.70 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 2,050,984.73  | - | 414,601.31    | 2,465,586.04  |
| 2. 基金赎回款                                 | -6,103,495.10 | - | -1,298,723.64 | -7,402,218.74 |
| （三）、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） | -             | - | -             | -             |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -             | - | -             | -             |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 1,367,001.61  | - | 383,405.01    | 1,750,406.62  |

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：

Wong Leah Kuen

刘冬

徐文

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]714号《关于准予先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由先锋基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集245,602,489.34元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第891号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年9月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额

为245,618,941.72份基金份额，其中认购资金利息折合16,452.38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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购、申购、赎回费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用，赎回时收取赎回费用，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，赎回时收取赎回费用的，称为C类基金份额。A类基金份额和C类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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、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)。本基金的投资组合比例为：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管理有限公司于2022年8月31日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、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》、《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022半年度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2022年6月30日的财务状况以及2022年半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 新金融工具准则

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

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管理金融资产的业务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。

###### 债务工具

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：

###### 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业务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。

###### 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。

###### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。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

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。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以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衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

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

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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和金融负债，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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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，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。

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。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和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。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。[对曾经实施份额拆分的基金]由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。[对曾经实施份额折算的基金]由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

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后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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利息收入。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利息收入。

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。

#### 6.4.4.10 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。

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类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净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本

基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 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、债券投资和资产支持证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，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》，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中基协发[2017]6号《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》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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告

和中期报告》》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为178,468.93元、6,865.28元、1,414.50元、24,278.08元、238,913.62元和1,128.64元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为178,500.04元、6,868.69元、1,415.27元、0.00元、238,913.62元和1,128.64元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为2,052,665.00元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为2,076,907.79元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为1,868.24元、1,726.83元、215.85元、290.41元、1,623.13元和1.29元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为1,868.24元、1,726.83元、215.85元、290.41元、1,623.13元和1.29元。

#### (b) 修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85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》、[适用于通过沪港通投资于香港联交所市场的基金]财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101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[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》、[适用于通过深港通投资于香港联交所市场的基金]财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

(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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末         |  |
|--------------|-------------|--|
|              | 2022年06月30日 |  |
| 活期存款         | 455,103.89  |  |
| 等于：本金        | 455,008.29  |  |
| 加：应计利息       | 95.60       |  |
| 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           | 455,103.89  |  |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末          |      |              |            |
|---------------|--------------|------|--------------|------------|
|               | 2022年06月30日  |      |              |            |
|               | 成本           | 应计利息 | 公允价值         | 公允价值变动     |
| 股票            | 3,945,196.13 | -    | 4,597,358.39 | 652,162.26 |
| 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     |       | 3,945,196.13 | - | 4,597,358.39 | - |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 26.84              |
| 应付交易费用      | 9,187.05           |
| 其中：交易所市场    | 9,187.05           |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 8,902.07           |

|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 18,115.96 |
|----|-----------|

#### 6.4.7.6 实收基金

##### 6.4.7.6.1 先锋聚优A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(先锋聚优A) | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |             |
|---------------|-------------------------------|-------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额        |
| 上年度末          | 656,345.41                    | 656,345.41  |
| 本期申购          | 972,721.56                    | 972,721.56  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -715,241.92                   | -715,241.92 |
| 本期末           | 913,825.05                    | 913,825.05  |

##### 6.4.7.6.2 先锋聚优C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(先锋聚优C) | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |               |
|---------------|-------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额          |
| 上年度末          | 1,272,369.74                  | 1,272,369.74  |
| 本期申购          | 4,861,626.06                  | 4,861,626.06  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,594,788.65                 | -3,594,788.65 |
| 本期末           | 2,539,207.15                  | 2,539,207.15  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.7 未分配利润

##### 6.4.7.7.1 先锋聚优A

单位：人民币元

| 项目<br>(先锋聚优A) | 已实现部分       | 未实现部分       | 未分配利润合计    |
|---------------|-------------|-------------|------------|
| 本期期初          | 430,837.50  | -254,202.01 | 176,635.49 |
| 本期利润          | -202,138.17 | 235,052.99  | 32,914.82  |
| 本期基金份额交易产     | 172,502.31  | -28,583.01  | 143,919.30 |

|          |             |             |             |
|----------|-------------|-------------|-------------|
| 生的变动数    |             |             |             |
| 其中：基金申购款 | 603,198.15  | -314,896.40 | 288,301.75  |
| 基金赎回款    | -430,695.84 | 286,313.39  | -144,382.45 |
| 本期已分配利润  | -           | -           | -           |
| 本期末      | 401,201.64  | -47,732.03  | 353,469.61  |

## 6.4.7.7.2 先锋聚优C

单位：人民币元

| 项目<br>(先锋聚优C)  | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计      |
|----------------|---------------|---------------|--------------|
| 本期期初           | 889,480.29    | -505,724.70   | 383,755.59   |
| 本期利润           | -520,957.73   | 386,615.58    | -134,342.15  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 837,717.68    | -18,325.11    | 819,392.57   |
| 其中：基金申购款       | 3,201,164.03  | -1,598,307.56 | 1,602,856.47 |
| 基金赎回款          | -2,363,446.35 | 1,579,982.45  | -783,463.90  |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -            |
| 本期末            | 1,206,240.24  | -137,434.23   | 1,068,806.01 |

## 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,233.88                      |
| 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 | 121.15                        |
| 其他        | 17.17                         |
| 合计        | 1,372.20                      |

## 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                      |
|------------|-------------------------|
|            | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 8,400,310.63            |
| 减：卖出股票成本总额 | 9,141,308.59            |
| 减：交易费用     | 25,957.74               |
| 买卖股票差价收入   | -766,955.70             |

#### 6.4.7.10 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期                      |
|-------------------------------|-------------------------|
|                               | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                  | 5,690.48                |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 27,552.90               |
| 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                            | 33,243.38               |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                      |
|-------------------------|-------------------------|
|                         | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,341,553.71            |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,280,736.51            |

|          |           |
|----------|-----------|
| 减：应计利息总额 | 33,261.71 |
| 减：交易费用   | 2.59      |
| 买卖债券差价收入 | 27,552.90 |

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                      |
|-------------|-------------------------|
|             | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 7,584.17                |
| 基金投资产生的股利收益 | -                       |
| 合计          | 7,584.17                |

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                      |
|------------|-------------------------|
|            | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 621,668.57              |
| ——股票投资     | 652,162.26              |
| ——债券投资     | -30,493.69              |
| ——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                     | 621,668.57 |

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 19,472.80               |
| 转换费收入   | 0.04                    |
| 合计      | 19,472.84               |

注：(1) 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

(2) 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                      |
|-------|-------------------------|
|       | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 审计费用  | -                       |
| 信息披露费 | -                       |
| 汇划手续费 | 662.72                  |
| 合计    | 662.72                  |

#### 6.4.7.18 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系               |
|----------------------|-----------------------|
| 先锋基金管理有限公司（“先锋基金”）   | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行                 | 基金托管人、基金销售机构          |
| 网信证券有限责任公司（“网信证券”）   | 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（“天津国美”） | 基金管理人股东的子公司、基金销售机构    |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

##### 6.4.10.1.5 基金交易

无。

##### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 13,189.05                     | 10,111.84                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,375.74                      | 5,472.52                           |

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0.80%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×0.80%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,648.65                      | 1,264.03                           |

注：支付基金托管人交通银行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。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |       |       |
|----------------|-------------------------------|-------|-------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费              |       |       |
|                | 先锋聚优A                         | 先锋聚优C | 合计    |
| 先锋基金           | 0.00                          | 4.46  | 4.46  |
| 交通银行           | 0.00                          | 15.50 | 15.50 |
| 合计             | -                             | 19.96 | 19.96 |
| 获得销售           | 上年度可比期间                       |       |       |

|            |                         |        |        |
|------------|-------------------------|--------|--------|
| 服务费的各关联方名称 | 2021年01月01日至2021年06月30日 |        |        |
|            | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |        |        |
|            | 先锋聚优A                   | 先锋聚优C  | 合计     |
| 先锋基金       | 0.00                    | 279.93 | 279.93 |
| 交通银行       | 0.00                    | 27.88  | 27.88  |
| 合计         | -                       | 307.81 | 307.81 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.20%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C类基金份额的基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |          | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021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   |
| 交通银行股份有限公司 | 455,008.29                    | 1,233.88 | 375,021.28                         | 1,271.53 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

#### 6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益水平低于股票型基金，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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。

##### 6.4.13.2.1 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<br>2022年06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | -                  | -                   |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | 2,052,665.00        |
| 合计     | -                  | 2,052,665.00        |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为剩余期限大于一年的国债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

于2022年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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的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期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上市公司发行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上述比例限制)。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(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%。于2022年6月30日，本基金无流动性受限资产。

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。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过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。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022 年 06<br>月 30 日 | 1 年以内      | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息          | 合计           |
|----------------------------|------------|-------|-------|--------------|--------------|
| 资产                         |            |       |       |              |              |
| 银行存款                       | 455,103.89 | -     | -     | -            | 455,103.89   |
| 结算备付金                      | 14,389.91  | -     | -     | -            | 14,389.91    |
| 存出保证金                      | 3,300.07   | -     | -     | -            | 3,300.07     |
| 交易性金融资产                    | -          | -     | -     | 4,597,358.39 | 4,597,358.39 |
| 应收申购款                      | -          | -     | -     | 29,541.06    | 29,541.06    |
| 资产总计                       | 472,793.87 | -     | -     | 4,626,899.45 | 5,099,693.32 |
| 负债                         |            |       |       |              |              |
| 应付清算款                      | -          | -     | -     | 164,736.99   | 164,736.99   |
| 应付赎回款                      | -          | -     | -     | 38,524.67    | 38,524.67    |
| 应付管理人报酬                    | -          | -     | -     | 2,315.71     | 2,315.71     |
| 应付托管费                      | -          | -     | -     | 289.47       | 289.47       |
| 应付销售                       | -          | -     | -     | 402.70       | 402.70       |

|                             |            |       |              |              |              |
|-----------------------------|------------|-------|--------------|--------------|--------------|
| 服务费                         |            |       |              |              |              |
| 其他负债                        | -          | -     | -            | 18,115.96    | 18,115.96    |
| 负债总计                        | -          | -     | -            | 224,385.50   | 224,385.50   |
| 利率敏感度缺口                     | 472,793.87 | -     | -            | 4,402,513.95 | 4,875,307.82 |
| 上年度末<br>2021 年 12<br>月 31 日 | 1 年以内      | 1-5 年 | 5 年以上        | 不计息          | 合计           |
| 资产                          |            |       |              |              |              |
| 银行存款                        | 178,468.93 | -     | -            | -            | 178,468.93   |
| 结算备付金                       | 6,865.28   | -     | -            | -            | 6,865.28     |
| 存出保证金                       | 1,414.50   | -     | -            | -            | 1,414.50     |
| 交易性金融资产                     | -          | -     | 2,052,665.00 | -            | 2,052,665.00 |
| 应收证券清算款                     | -          | -     | -            | 238,913.62   | 238,913.62   |
| 应收利息                        | -          | -     | -            | 24,278.08    | 24,278.08    |
| 应收申购款                       | -          | -     | -            | 1,128.64     | 1,128.64     |
| 资产总计                        | 186,748.71 | -     | 2,052,665.00 | 264,320.34   | 2,503,734.05 |
| 负债                          |            |       |              |              |              |
| 应付赎回款                       | -          | -     | -            | 1,868.24     | 1,868.24     |
| 应付管理人报酬                     | -          | -     | -            | 1,726.83     | 1,726.83     |
| 应付托管费                       | -          | -     | -            | 215.85       | 215.85       |
| 应付销售服务费                     | -          | -     | -            | 290.41       | 290.41       |
| 应付交易费用                      | -          | -     | -            | 1,623.13     | 1,623.13     |
| 其他负债                        | -          | -     | -            | 8,903.36     | 8,903.36     |
| 负债总计                        | -          | -     | -            | 14,627.82    | 14,627.82    |
| 利率敏感度缺口                     | 186,748.71 | -     | 2,052,665.00 | 249,692.52   | 2,489,106.23 |

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |
|----|--------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |
|----|--------------------|

| 分析             | 相关风险变量的变动      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币元) |                     |
|----------------|----------------|---------------------------------|---------------------|
|                |                | 本期末<br>2022年06月30日              | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|                | 1. 市场利率下降25个基点 | -                               | 89,041.00           |
| 2. 市场利率上升25个基点 | -              | -84,446.00                      |                     |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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%，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。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2022年06月30日 |                          | 上年度末<br>2021年12月31日 |                          |
|--------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|        | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资 | 4,597,358.39       | 94.30                    | -                   | -                        |

|               |              |       |   |   |
|---------------|--------------|-------|---|---|
| 产—股票投资        |              |       |   |   |
| 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            | 4,597,358.39 | 94.30 | - | - |

#### 6.4.13.4.3.2 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<br>2022年06月30日          | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|    | 1. 沪深300指数上升5%        | 262,414.20                  | -                   |
|    | 2. 沪深300指数下降5%        | -262,414.20                 | -                   |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 4,597,358.39       | -                   |
| 第二层次          | -                  | 2,052,665.00        |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 4,597,358.39       | 2,052,665.00        |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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  | 4,597,358.39 | 90.15        |
|    | 其中：股票 | 4,597,358.39 | 90.15        |

|   |                   |              |        |
|---|-------------------|--------------|--------|
| 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          | -            | -      |
|   | 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      | 469,493.80   | 9.21   |
| 8 | 其他各项资产            | 32,841.13    | 0.64   |
| 9 | 合计                | 5,099,693.32 | 100.00 |

## 7.2 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              | 3,987,759.96 | 81.80        |
| 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           | 140,320.00   | 2.88         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 123,030.00   | 2.52         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 110,750.00   | 2.27         |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| 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       | 123,278.43   | 2.53         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 112,220.00   | 2.30         |
| 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        | 4,597,358.39 | 94.30 |

### 7.3 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<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-------|------------|----------------------|
| 1  | 688116 | 天奈科技 | 1,101 | 186,597.48 | 3.83                 |
| 2  | 688499 | 利元亨  | 706   | 156,237.80 | 3.20                 |
| 3  | 002709 | 天赐材料 | 2,400 | 148,944.00 | 3.06                 |
| 4  | 300769 | 德方纳米 | 360   | 147,124.80 | 3.02                 |
| 5  | 688005 | 容百科技 | 1,135 | 146,914.40 | 3.01                 |
| 6  | 300755 | 华致酒行 | 3,200 | 140,320.00 | 2.88                 |
| 7  | 300432 | 富临精工 | 6,250 | 137,500.00 | 2.82                 |
| 8  | 688696 | 极米科技 | 445   | 137,002.15 | 2.81                 |
| 9  | 688707 | 振华新材 | 1,761 | 133,254.87 | 2.73                 |
| 10 | 688063 | 派能科技 | 414   | 129,250.80 | 2.65                 |
| 11 | 688556 | 高测股份 | 1,601 | 129,200.70 | 2.65                 |
| 12 | 603799 | 华友钴业 | 1,340 | 128,130.80 | 2.63                 |
| 13 | 300593 | 新雷能  | 3,080 | 127,850.80 | 2.62                 |
| 14 | 300260 | 新莱应材 | 2,500 | 127,175.00 | 2.61                 |
| 15 | 605123 | 派克新材 | 900   | 126,648.00 | 2.60                 |
| 16 | 002180 | 纳思达  | 2,500 | 126,550.00 | 2.60                 |
| 17 | 002812 | 恩捷股份 | 500   | 125,225.00 | 2.57                 |
| 18 | 688202 | 美迪西  | 363   | 123,278.43 | 2.53                 |
| 19 | 603713 | 密尔克卫 | 900   | 123,030.00 | 2.52                 |
| 20 | 002539 | 云图控股 | 7,600 | 121,524.00 | 2.49                 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 21 | 002645 | 华宏科技 | 5,500  | 120,010.00 | 2.46 |
| 22 | 300568 | 星源材质 | 3,993  | 115,956.72 | 2.38 |
| 23 | 688123 | 聚辰股份 | 1,082  | 115,254.64 | 2.36 |
| 24 | 300772 | 运达股份 | 4,500  | 114,480.00 | 2.35 |
| 25 | 002049 | 紫光国微 | 600    | 113,832.00 | 2.33 |
| 26 | 002258 | 利尔化学 | 4,800  | 113,376.00 | 2.33 |
| 27 | 002466 | 天齐锂业 | 900    | 112,320.00 | 2.30 |
| 28 | 002549 | 凯美特气 | 6,200  | 112,220.00 | 2.30 |
| 29 | 002850 | 科达利  | 700    | 111,300.00 | 2.28 |
| 30 | 603613 | 国联股份 | 1,250  | 110,750.00 | 2.27 |
| 31 | 603659 | 璞泰来  | 1,300  | 109,720.00 | 2.25 |
| 32 | 301071 | 力量钻石 | 700    | 108,591.00 | 2.23 |
| 33 | 300573 | 兴齐眼药 | 700    | 107,324.00 | 2.20 |
| 34 | 600172 | 黄河旋风 | 12,000 | 104,640.00 | 2.15 |
| 35 | 002460 | 赣锋锂业 | 700    | 104,090.00 | 2.14 |
| 36 | 300775 | 三角防务 | 2,100  | 101,115.00 | 2.07 |
| 37 | 300035 | 中科电气 | 3,600  | 100,620.00 | 2.06 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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  | 300755 | 华致酒行 | 448,847.00 | 18.03           |
| 2  | 300260 | 新莱应材 | 417,128.00 | 16.76           |
| 3  | 002460 | 赣锋锂业 | 417,107.00 | 16.76           |
| 4  | 002756 | 永兴材料 | 413,650.00 | 16.62           |
| 5  | 603713 | 密尔克卫 | 405,781.00 | 16.30           |
| 6  | 002472 | 双环传动 | 395,380.00 | 15.88           |
| 7  | 300748 | 金力永磁 | 389,675.40 | 15.66           |
| 8  | 300012 | 华测检测 | 388,869.00 | 15.62           |

|    |        |      |            |       |
|----|--------|------|------------|-------|
| 9  | 002049 | 紫光国微 | 377,930.00 | 15.18 |
| 10 | 300568 | 星源材质 | 372,124.00 | 14.95 |
| 11 | 688116 | 天奈科技 | 370,019.93 | 14.87 |
| 12 | 603198 | 迎驾贡酒 | 368,132.00 | 14.79 |
| 13 | 603986 | 兆易创新 | 366,606.00 | 14.73 |
| 14 | 688005 | 容百科技 | 365,078.72 | 14.67 |
| 15 | 002850 | 科达利  | 362,495.00 | 14.56 |
| 16 | 300122 | 智飞生物 | 346,984.00 | 13.94 |
| 17 | 605111 | 新洁能  | 338,518.00 | 13.60 |
| 18 | 688508 | 芯朋微  | 324,687.53 | 13.04 |
| 19 | 300751 | 迈为股份 | 321,177.00 | 12.90 |
| 20 | 688301 | 奕瑞科技 | 309,922.96 | 12.45 |
| 21 | 688536 | 思瑞浦  | 264,424.00 | 10.62 |
| 22 | 688356 | 键凯科技 | 242,406.00 | 9.74  |
| 23 | 688696 | 极米科技 | 208,289.00 | 8.37  |
| 24 | 688598 | 金博股份 | 191,461.56 | 7.69  |
| 25 | 300316 | 晶盛机电 | 149,537.00 | 6.01  |
| 26 | 300395 | 菲利华  | 145,488.00 | 5.84  |
| 27 | 300772 | 运达股份 | 144,984.00 | 5.82  |
| 28 | 601899 | 紫金矿业 | 136,145.00 | 5.47  |
| 29 | 002645 | 华宏科技 | 131,034.00 | 5.26  |
| 30 | 688499 | 利元亨  | 130,389.36 | 5.24  |
| 31 | 002539 | 云图控股 | 129,937.00 | 5.22  |
| 32 | 600172 | 黄河旋风 | 129,277.00 | 5.19  |
| 33 | 603613 | 国联股份 | 129,138.00 | 5.19  |
| 34 | 688556 | 高测股份 | 127,433.81 | 5.12  |
| 35 | 002459 | 晶澳科技 | 126,962.00 | 5.10  |
| 36 | 002258 | 利尔化学 | 124,084.60 | 4.99  |
| 37 | 688617 | 惠泰医疗 | 123,198.40 | 4.95  |
| 38 | 300327 | 中颖电子 | 123,044.00 | 4.94  |
| 39 | 002180 | 纳思达  | 122,960.00 | 4.94  |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 40 | 002709 | 天赐材料 | 121,716.00 | 4.89 |
| 41 | 688123 | 聚辰股份 | 120,105.10 | 4.83 |
| 42 | 300432 | 富临精工 | 118,754.00 | 4.77 |
| 43 | 600547 | 山东黄金 | 116,262.00 | 4.67 |
| 44 | 301071 | 力量钻石 | 113,511.00 | 4.56 |
| 45 | 688707 | 振华新材 | 112,537.67 | 4.52 |
| 46 | 002812 | 恩捷股份 | 112,478.00 | 4.52 |
| 47 | 002549 | 凯美特气 | 112,475.00 | 4.52 |
| 48 | 605123 | 派克新材 | 112,022.00 | 4.50 |
| 49 | 300593 | 新雷能  | 111,218.00 | 4.47 |
| 50 | 603392 | 万泰生物 | 110,742.00 | 4.45 |
| 51 | 000519 | 中兵红箭 | 109,004.00 | 4.38 |
| 52 | 603799 | 华友钴业 | 108,602.00 | 4.36 |
| 53 | 688516 | 奥特维  | 106,450.62 | 4.28 |
| 54 | 300573 | 兴齐眼药 | 105,932.00 | 4.26 |
| 55 | 688202 | 美迪西  | 103,600.00 | 4.16 |
| 56 | 300035 | 中科电气 | 103,556.00 | 4.16 |
| 57 | 300775 | 三角防务 | 103,292.00 | 4.15 |
| 58 | 002466 | 天齐锂业 | 102,204.00 | 4.11 |
| 59 | 300769 | 德方纳米 | 101,246.00 | 4.07 |
| 60 | 603659 | 璞泰来  | 94,954.00  | 3.81 |
| 61 | 300171 | 东富龙  | 84,646.00  | 3.40 |
| 62 | 688107 | 安路科技 | 84,277.16  | 3.39 |
| 63 | 688063 | 派能科技 | 84,234.90  | 3.38 |
| 64 | 600809 | 山西汾酒 | 80,420.00  | 3.23 |
| 65 | 300759 | 康龙化成 | 71,960.00  | 2.89 |

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。

#### 7.4.2 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<br>(%) |
|----|--------|------|------------|--------------------|
| 1  | 300012 | 华测检测 | 395,467.00 | 15.89              |
| 2  | 002756 | 永兴材料 | 371,013.00 | 14.91              |
| 3  | 002472 | 双环传动 | 356,495.00 | 14.32              |
| 4  | 300122 | 智飞生物 | 331,825.00 | 13.33              |
| 5  | 603198 | 迎驾贡酒 | 321,399.00 | 12.91              |
| 6  | 300748 | 金力永磁 | 316,207.80 | 12.70              |
| 7  | 300751 | 迈为股份 | 307,608.00 | 12.36              |
| 8  | 603986 | 兆易创新 | 307,118.00 | 12.34              |
| 9  | 002460 | 赣锋锂业 | 298,287.00 | 11.98              |
| 10 | 605111 | 新洁能  | 283,108.20 | 11.37              |
| 11 | 688301 | 奕瑞科技 | 275,262.88 | 11.06              |
| 12 | 300755 | 华致酒行 | 271,289.00 | 10.90              |
| 13 | 603713 | 密尔克卫 | 263,405.00 | 10.58              |
| 14 | 300568 | 星源材质 | 256,803.00 | 10.32              |
| 15 | 688508 | 芯朋微  | 248,241.26 | 9.97               |
| 16 | 300260 | 新莱应材 | 247,992.00 | 9.96               |
| 17 | 002850 | 科达利  | 239,001.00 | 9.60               |
| 18 | 002049 | 紫光国微 | 227,249.00 | 9.13               |
| 19 | 688356 | 键凯科技 | 221,217.44 | 8.89               |
| 20 | 688536 | 思瑞浦  | 217,277.00 | 8.73               |
| 21 | 688116 | 天奈科技 | 207,212.33 | 8.32               |
| 22 | 688005 | 容百科技 | 201,370.94 | 8.09               |
| 23 | 688598 | 金博股份 | 192,430.24 | 7.73               |
| 24 | 300316 | 晶盛机电 | 144,127.00 | 5.79               |
| 25 | 300395 | 菲利华  | 142,509.00 | 5.73               |
| 26 | 002459 | 晶澳科技 | 141,892.00 | 5.70               |
| 27 | 688617 | 惠泰医疗 | 134,729.83 | 5.41               |
| 28 | 688516 | 奥特维  | 120,060.00 | 4.82               |
| 29 | 601899 | 紫金矿业 | 117,748.00 | 4.73               |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 30 | 300327 | 中颖电子 | 114,833.00 | 4.61 |
| 31 | 600547 | 山东黄金 | 113,493.00 | 4.56 |
| 32 | 300772 | 运达股份 | 99,434.00  | 3.99 |
| 33 | 000519 | 中兵红箭 | 98,083.00  | 3.94 |
| 34 | 688107 | 安路科技 | 92,371.38  | 3.71 |
| 35 | 300171 | 东富龙  | 87,492.00  | 3.51 |
| 36 | 300759 | 康龙化成 | 76,620.00  | 3.08 |
| 37 | 603392 | 万泰生物 | 74,748.00  | 3.00 |
| 38 | 600809 | 山西汾酒 | 73,596.00  | 2.96 |
| 39 | 688696 | 极米科技 | 70,716.00  | 2.84 |
| 40 | 688556 | 高测股份 | 69,009.78  | 2.77 |

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。

#### 7.4.3 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 | 13,086,504.72 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 8,400,310.63  |

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。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏天奈科技股份有限公司在报告编制日前一年内收到中国证券监督管理委员会江苏监管局下发的《江苏证监局关于对江苏天奈科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》（2021）156号，绵阳富临精工股份有限公司在报告编制日前一年内收到中国证券监督管理委员会四川监管局下发的《关于对绵阳富临精工股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2021]41号），深圳市德方纳米科技股份有限公司控股子公司在报告编制日前一年内收到曲靖市应急管理局的行政处罚决定书。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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 | 3,300.07  |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 29,541.06 |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |

|   |    |           |
|---|----|-----------|
| 8 | 其他 | -         |
| 9 | 合计 | 32,841.13 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 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。

### § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>份额<br>比例 | 持有份额         | 占总份额<br>比例 |
| 先锋聚优A | 406          | 2,250.80      | 0.00      | 0.00%          | 913,825.05   | 100.00%    |
| 先锋聚优C | 535          | 4,746.18      | 25,326.93 | 1.00%          | 2,513,880.22 | 99.00%     |
| 合计    | 941          | 3,669.53      | 25,326.93 | 0.73%          | 3,427,705.27 | 99.27%     |

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 份额级别  | 持有份额总数<br>(份) | 占基金总份额比<br>例 |
|----------------------|-------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有<br>本基金 | 先锋聚优A | 11,687.84     | 1.2790%      |
|                      | 先锋聚优C | 0.00          | 0.00%        |
|                      | 合计    | 11,687.84     | 0.3385%      |

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别  | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 先锋聚优A | 0                 |
|                                | 先锋聚优C | 0                 |
|                                | 合计    | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 先锋聚优A | 0                 |
|                                | 先锋聚优C | 0                 |
|                                | 合计    | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 先锋聚优A        | 先锋聚优C          |
|----------------------------|--------------|----------------|
| 基金合同生效日(2017年09月15日)基金份额总额 | 3,695,376.51 | 241,923,565.21 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 656,345.41   | 1,272,369.74   |
| 本报告期基金总申购份额                | 972,721.56   | 4,861,626.06   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 715,241.92   | 3,594,788.65   |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -            | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 913,825.05   | 2,539,207.15   |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人本报告期内重大人事变动：

高级管理人员变动：2022年1月4日，刘东先生离任公司总经理，高明达先生代任公司总经理职务；2022年1月27日，公司聘任黄劲松女士为公司督察长；2022年2月21日，公司聘任Wong Leah Kuen女士为公司总经理，高明达先生不再代任公司总经理职务；2022年4月30日，朱明方先生离任公司副总经理；2022年5月30日，易琳女士离任公司副总经理。

本报告期内托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况如下：

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|-------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|       |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 新时代证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 银河证券  | 2      | 21,486,815.35 | 100.00%      | 15,713.67 | 100.00%    | -  |

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需

要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 债券交易         |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|-------|--------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|       | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 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 |
| 新时代证券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券  | 2,566,857.20 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

### 10.8 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关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 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 | 2022-01-12 |
| 2  | 先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金2021年第四季度报告             | 证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站                  | 2022-01-22 |
| 3  | 先锋基金管理有限公司产品风险等级评级方法与说明                  | 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 | 2022-03-24 |
| 4  | 先锋基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京中植基金销售有限公司为销售机     | 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  | 2022-03-24 |

|    |   |                                       |            |
|----|---|---------------------------------------|------------|
|    | 构及开通定投和转换业务并参加其费率优惠活动的公告  | 站                                     |            |
| 5  | 先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金2021年年度报告  | 证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站                  | 2022-03-31 |
| 6  | 先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金2022年第一季度报告  | 证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站                  | 2022-04-22 |
| 7  | 先锋基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司、北京植信基金销售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 | 2022-04-27 |
| 8  | 先锋基金管理有限公司2022年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 | 2022-04-30 |
| 9  | 先锋基金管理有限公司2022年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 | 2022-05-31 |
| 10 | 先锋基金管理有限公司关于旗下基金代销机构名称变更的公告   | 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 | 2022-06-24 |

## § 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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 报告期内先锋聚优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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人先锋基金管理有限公司

官方网站：<http://www.xf-fund.com>

先锋基金管理有限公司  
二〇二二年八月三十一日