

# 先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 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:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
§4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
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 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
§5 托管人报告 .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
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 .....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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 .....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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 .....	47
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50

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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	先锋量化优选	
基金主代码	006401	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年05月15日	
基金管理人	先锋基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	34,310,635.65份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	先锋量化优选A	先锋量化优选C
下属分级基金的交易代码	006401	006402
报告期末下属分级基金的份额总额	31,187,662.79份	3,122,972.86份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化投资模型精选个股，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过系统地分析中国证券市场的特点和运作规律，以深入的基本面研究为基础，采取自下而上的方法，精选具备基本面健康、核心竞争力强、成长潜力大的投资标的，采用量化模型构建投资组合。
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露	姓名	黄劲松	任航

露负责人	联系电话	400-815-9998	010-66060069
	电子邮箱	heguifengkong@xf-fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-815-9998	95599
传真		010-58239896	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518046	100031
法定代表人		Wong Leah Kuen	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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	深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 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
---------------	-----

	(2024年01月01日-2024年06月30日)	
	先锋量化优选A	先锋量化优选C
本期已实现收益	-21,230.27	-30,804.68
本期利润	-3,310,452.05	-610,974.34
加权平均基金份额本期利润	-0.1021	-0.1451
本期加权平均净值利润率	-7.54%	-11.07%
本期基金份额净值增长率	-6.57%	-6.81%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	41,135,442.41	918,613.97
期末可供分配基金份额利润	1.3190	0.2941
期末基金资产净值	42,305,944.43	4,089,841.88
期末基金份额净值	1.3565	1.3096
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6240.06%	30.96%

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

先锋量化优选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	-0.97%	1.01%	-1.41%	0.26%	0.44%	0.75%
过去三个月	-0.01%	0.93%	-0.36%	0.40%	0.35%	0.53%

过去六个月	-6.57%	1.05%	2.33%	0.48%	-8.90%	0.57%
过去一年	-11.06%	0.88%	-2.84%	0.47%	-8.22%	0.41%
过去三年	-23.32%	1.32%	-13.77%	0.57%	-9.55%	0.75%
自基金合同生效起至今	6240.06%	128.71%	10.52%	0.62%	6229.54%	128.09%

先锋量化优选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	-1.01%	1.01%	-1.41%	0.26%	0.40%	0.75%
过去三个月	-0.14%	0.93%	-0.36%	0.40%	0.22%	0.53%
过去六个月	-6.81%	1.05%	2.33%	0.48%	-9.14%	0.57%
过去一年	-11.50%	0.88%	-2.84%	0.47%	-8.66%	0.41%
过去三年	-24.47%	1.31%	-13.77%	0.57%	-10.70%	0.74%
自基金合同生效起至今	30.96%	1.26%	10.52%	0.62%	20.44%	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



先锋量化优选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  
(2019年05月15日-2024年06月30日)



先锋量化优选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  
(2019年05月15日-2024年06月30日)



注：本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

先锋基金管理有限公司(以下简称"先锋基金")于2016年4月19日经中国证监会批准,2016年5月16日注册成立,截至报告期末,注册资本为1.5亿元人民币。其中,联合创业集团有限公司占注册资本的34.2076%,大连亚联投资管理有限公司占注册资本的33.3074%,北京鹏康投资有限公司占注册资本的22.5050%,北京指南针科技发展股份有限公司占注册资本的4.9900%,深圳大华信安私募证券投资基金管理企业(有限合伙)占注册资本的4.9900%。截至报告期末,先锋基金旗下管理先锋现金宝货币市场基金、先锋精一灵活配置混合型发起式证券投资基金、先锋聚元灵活配置混合型证券投资基金、先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金、先锋聚利灵活配置混合型证券投资基金、先锋日添利货币市场基金、先锋汇盈纯债债券型证券投资基金、先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金及先锋博盈纯债债券型证券投资基金9只开放式基金。

### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾捷	基金经理	2022-12-28	-	10年	北京航空航天大学工学硕士,曾任安信证券股份有限公司研究员、华金证券股份有限公司研究员。2021年6月加入先锋基金管理有限公司任研究员。

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与本公司管理的其他投资组合之间有导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，未出现本公司管理的投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年权益市场V型反转后震荡，市场有结构性表现，高股息领涨，大盘跑赢小票，银行、煤炭、家电占优；大消费、TMT疲软。一季度，本基金增加半导体设计和封测公司的持仓。二季度，本基金增加了军工、国产算力的持仓。复盘本报告期，本基金在节点和风格上的把握上，还有继续提升的空间，将争取可以做的更好。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末先锋量化优选A基金份额净值为1.3565元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.57%，同期业绩比较基准收益率为2.33%；截至报告期末先锋量化优选C基金份额净值为1.3096元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.81%，同期业绩比较基准收益率为2.33%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济周期处于底部，稳增长和经济转型同步进行，量价、内外需分化，延续“量强价弱”，消费走弱，生产强。私营部门“资产负债表”疲弱，从政策预期看，货币进一

步宽松，财政也盼进一步发力。我们认为哑铃策略今年依旧有效，杠铃两头中的成长一头在缩圈，必须有业绩为支撑。下半年，本基金将重点聚焦AI产业趋势，把握产业周期，并持续关注投资组合的抗风险能力，力争减少净值波动，争取为基金持有人创造长期可持续的较高投资收益。

#### 4.6 管理人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2024年3月25日起至本报告期末，本基金的基金资产净值存在连续二十个工作日低于5000万元的情形，至本报告期期末基金资产净值仍低于5000万元。

至本报告期末，本基金存在连续超六十个工作日基金资产净值低于5000万的情形，基金管理人前期已按照基金合同约定向中国证监会报告并提出解决方案。持续营销严格遵循法律法规，注重风险揭示与投资者适当性管理，精准市场定位，多元化渠道布局，持续优化客户服务。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-先锋基金管理有限公司 2024年1月1日至 2024年6月30日基金的投资

运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,先锋基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，先锋基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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：先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	21,486,984.73	30,969,419.21
结算备付金		22,973.08	954,589.18
存出保证金		4,020.95	15,102.75
交易性金融资产	6.4.7.2	25,217,944.90	26,022,543.47
其中：股票投资		24,269,383.51	25,796,637.17
基金投资		-	-
债券投资		948,561.39	225,906.30
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		-	11,743,000.00
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		19,828.12	38,375.40
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		46,751,751.78	69,743,030.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023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		108,196.11	10,758,240.94
应付赎回款		140,754.32	77,446.74
应付管理人报酬		46,450.04	61,840.60
应付托管费		5,806.24	7,730.07
应付销售服务费		1,713.85	4,492.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30.08	11.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.4	53,014.83	120,580.59
负债合计		355,965.47	11,030,342.59
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.5	3,790,236.53	7,347,779.32
未分配利润	6.4.7.6	42,605,549.78	51,364,908.10

净资产合计		46,395,786.31	58,712,687.42
负债和净资产总计		46,751,751.78	69,743,030.01

注：截至2024年06月30日止，基金份额总额34,310,635.65份，其中A类基金份额净值1.3565元，基金份额为31,187,662.79份；C类基金份额净值1.3096元，基金份额为3,122,972.86份。

## 6.2 利润表

会计主体：先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-3,522,633.83	7,572,450.36
1.利息收入		110,248.61	317,984.40
其中：存款利息收入	6.4.7.7	97,245.01	89,837.84
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,003.60	228,146.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		228,420.85	-3,468,853.00
其中：股票投资收益	6.4.7.8	92,535.72	-3,600,829.39
基金投资收益	6.4.7.9	-	-
债券投资收益	6.4.7.10	1,831.66	765.67
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	6.4.7.11	134,053.47	131,210.72

其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.12	-3,869,391.44	10,666,183.12
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.13	8,088.15	57,135.84
<b>减：二、营业总支出</b>		398,792.56	737,222.84
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	294,708.55	585,651.46
2.托管费	6.4.10.2.2	36,838.56	58,565.08
3.销售服务费	6.4.10.2.3	13,769.17	43,098.35
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		6.68	2.96
8.其他费用	6.4.7.14	53,469.60	49,904.99
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-3,921,426.39	6,835,227.52
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-3,921,426.39	6,835,227.52
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-3,921,426.39	6,835,227.52

### 6.3 净资产变动表

会计主体：先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,347,779.32	51,364,908.10	58,712,687.42
二、本期期初净资产	7,347,779.32	51,364,908.10	58,712,687.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,557,542.79	-8,759,358.32	-12,316,901.11
（一）、综合收益总额	-	-3,921,426.39	-3,921,426.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-3,557,542.79	-4,837,931.93	-8,395,474.72
其中：1.基金申购款	313,825.64	3,225,692.69	3,539,518.33
2.基金赎回款	-3,871,368.43	-8,063,624.62	-11,934,993.05
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	3,790,236.53	42,605,549.78	46,395,786.31
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	16,254,632.97	63,934,026.72	80,188,659.69
二、本期期初净资产	16,254,632.97	63,934,026.72	80,188,659.69

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,011,565.55	-1,651,769.63	-7,663,335.18
（一）、综合收益总额	-	6,835,227.52	6,835,227.52
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-6,011,565.55	-8,486,997.15	-14,498,562.70
其中：1.基金申购款	2,016,564.06	13,955,770.84	15,972,334.90
2.基金赎回款	-8,028,129.61	-22,442,767.99	-30,470,897.60
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	10,243,067.42	62,282,257.09	72,525,324.51

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：

龙涌

吴越

谢玲玉

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称本基金或基金)系经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)《关于准予先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2018〕1388号)核准，由先锋基金管理有限公司(以下简称先锋基金公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》《先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金类型为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集202,510,788.14元，设立时募集

资金到位情况业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并由其出具《验资报告》(普华永道中天验字〔2019〕第0289号)。经向中国证监会备案,《先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2019年5月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额共计202,511,294.95份,其中认购资金利息折合506.81份基金份额。本基金的管理人为先锋基金公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称农业银行)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资范围为:具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、资产支持证券、次级债、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)。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在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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 $\times$ 55%+中债总指数收益率 $\times$ 45%。

本财务报表由本基金的基金管理人先锋基金公司于2024年8月29日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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

本基金财务报表符合企业会计准则和财政部《资产管理产品相关会计处理规定》(财会〔2022〕14号)、中国证券投资基金业协会(以下简称中国基金业协会)《证券投资基金会计核算业务指引》的要求,并按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》编制,真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况以及2024年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

本基金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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税〔2002〕128号)、《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46号)、《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》(财税〔2016〕70号)、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税〔2017〕2号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号)及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对

基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	21,486,984.73
等于：本金	21,482,603.49
加：应计利息	4,381.24
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	21,486,984.73

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		29,082,782.32	-	24,269,383.51	-4,813,398.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	988,108.22	10,263.19	948,561.39	-49,810.02
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	988,108.22	10,263.19	948,561.39	-49,810.02
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		30,070,890.54	10,263.19	25,217,944.90	-4,863,208.83

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

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	68.93
应付交易费用	3,219.86
其中：交易所市场	3,219.86
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,726.04
合计	53,014.83

### 6.4.7.5 实收基金

#### 6.4.7.5.1 先锋量化优选A

金额单位：人民币元

项目 (先锋量化优选A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,030,714.10	728,091.16
本期申购	2,362,546.41	50,547.11
本期赎回（以“-”号填列）	-5,205,597.72	-111,374.60
本期末	31,187,662.79	667,263.67

#### 6.4.7.5.2 先锋量化优选C

金额单位：人民币元

项目 (先锋量化优选C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,619,688.16	6,619,688.16
本期申购	263,278.53	263,278.53
本期赎回（以“-”号填列）	-3,759,993.83	-3,759,993.83
本期末	3,122,972.86	3,122,972.86

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.6 未分配利润

#### 6.4.7.6.1 先锋量化优选A

单位：人民币元

项目 (先锋量化优选A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	44,889,304.96	3,792,863.81	48,682,168.77
本期期初	44,889,304.96	3,792,863.81	48,682,168.77
本期利润	-21,230.27	-3,289,221.78	-3,310,452.05
本期基金份额交易产	-3,732,632.28	-403.68	-3,733,035.96

生的变动数			
其中：基金申购款	3,102,340.13	43,678.31	3,146,018.44
基金赎回款	-6,834,972.41	-44,081.99	-6,879,054.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,135,442.41	503,238.35	41,638,680.76

#### 6.4.7.6.2 先锋量化优选C

单位：人民币元

项目 (先锋量化优选C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,969,781.11	712,958.22	2,682,739.33
本期期初	1,969,781.11	712,958.22	2,682,739.33
本期利润	-30,804.68	-580,169.66	-610,974.34
本期基金份额交易产生的变动数	-1,020,362.46	-84,533.51	-1,104,895.97
其中：基金申购款	76,422.45	3,251.80	79,674.25
基金赎回款	-1,096,784.91	-87,785.31	-1,184,570.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	918,613.97	48,255.05	966,869.02

#### 6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	95,258.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,924.78
其他	61.97
合计	97,245.01

[注]其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等



### 6.4.7.8 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	5,816,564.57
减：卖出股票成本总额	5,712,778.51
减：交易费用	11,250.34
买卖股票差价收入	92,535.72

### 6.4.7.9 基金投资收益

无。

### 6.4.7.10 债券投资收益

#### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	1,862.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-30.43
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	1,831.66

#### 6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债	-

转股及债券到期兑 付) 成本总额	
减: 应计利息总额	-
减: 交易费用	30.43
买卖债券差价收入	-30.43

#### 6.4.7.11 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	134,053.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	134,053.47

#### 6.4.7.12 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-3,869,391.44
——股票投资	-3,828,936.50
——债券投资	-40,454.94
——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	-3,869,391.44

### 6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	8,085.48
转换费收入	2.67
合计	8,088.15

注：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。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25%归入转出基金的基金资产。

### 6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	9,944.48
信息披露费	39,781.56
汇划手续费	3,743.56
合计	53,469.60

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至2024年6月30日，本基金不存在应披露未披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金不存在应披露未披露的重大资产负债表日后事项。

## 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

无。

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 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 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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	294,708.55	585,651.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	120,041.52	230,671.56
应支付基金管理人的净管理费	174,667.03	354,979.90

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

注2: 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,838.56	58,565.08

注: 支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%÷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		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	先锋量化优选A	先锋量化优选C	合计
先锋基金	0.00	2,665.49	2,665.49
合计	0.00	2,665.49	2,665.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	先锋量化优选A	先锋量化优选C	合计
先锋基金	0.00	13,341.35	13,341.35
合计	0.00	13,341.35	13,341.35

注: 本基金A类基金份额不收取销售服务费。C类份额的销售服务费率年费率为0.50%。支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付给先锋基金，再由先锋基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C类日销售服务费=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

先锋量化优选C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至 2024年06月30日	2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	2,600,000.89	3,648,176.89
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,600,000.89	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	3,648,176.89
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	38.72%

注：基金管理人先锋基金在本年度申购本基金的交易委托先锋基金直销中心办理，适用费率按照本基金招募说明书的规定执行。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

#### 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		上年度可比期间	
	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023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
中国农业	21,486,984.73	95,258.26	13,516,688.84	78,896.36

银行股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 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

本基金本报告期未分红。

#### 6.4.12 期末（2024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同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示。如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有以上相应投资。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

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

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。



#### 6.4.13.2.4 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	948,561.39	225,906.30
未评级	-	-
合计	948,561.39	225,906.30

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 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于开放期内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2024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(所有者权益)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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（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2024年6月30日，本基金未持有流动性受限资产。

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。

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 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,486,984.73	-	-	-	21,486,984.73
结算备付金	22,973.08	-	-	-	22,973.08
存出保证金	4,020.95	-	-	-	4,020.95
交易性金融资产	948,561.39	-	-	24,269,383.51	25,217,944.90
应收申购款	-	-	-	19,828.12	19,828.12
资产总计	22,462,540.15	-	-	24,289,211.63	46,751,751.78
负债					
应付清算款	-	-	-	108,196.11	108,196.11
应付赎回款	-	-	-	140,754.32	140,754.32
应付管理人报酬	-	-	-	46,450.04	46,450.04
应付托管费	-	-	-	5,806.24	5,806.24
应付销售服务费	-	-	-	1,713.85	1,713.85
应交税	-	-	-	30.08	30.08

费					
其他负债	-	-	-	53,014.83	53,014.83
负债总计	-	-	-	355,965.47	355,965.47
利率敏感度缺口	22,462,540.15	-	-	23,933,246.16	46,395,786.31
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,969,419.21	-	-	-	30,969,419.21
结算备付金	954,589.18	-	-	-	954,589.18
存出保证金	15,102.75	-	-	-	15,102.75
交易性金融资产	225,906.30	-	-	25,796,637.17	26,022,543.47
买入返售金融资产	11,743,000.00	-	-	-	11,743,000.00
应收申购款	-	-	-	38,375.40	38,375.40
资产总计	43,908,017.44	-	-	25,835,012.57	69,743,030.01
负债					
应付清算款	-	-	-	10,758,240.94	10,758,240.94
应付赎回款	-	-	-	77,446.74	77,446.74
应付管理人报	-	-	-	61,840.60	61,840.60

酬					
应付托管费	-	-	-	7,730.07	7,730.07
应付销售服务费	-	-	-	4,492.55	4,492.55
应交税费	-	-	-	11.10	11.10
其他负债	-	-	-	120,580.59	120,580.59
负债总计	-	-	-	11,030,342.59	11,030,342.59
利率敏感度缺口	43,908,017.44	-	-	14,804,669.98	58,712,687.42

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	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
假设	假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化。		
假设	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	3,153.88	1,672.22
	市场利率上升25个基点	-3,129.75	-1,655.72

#### 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%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	24,269,383.51	52.31	25,796,637.17	43.94
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	948,561.39	2.04	225,906.30	0.38
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	25,217,944.90	54.35	26,022,543.47	44.32

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	沪深300指数上升5%	2,223,023.93	1,475,524.08
	沪深300指数下降5%	-2,223,023.93	-1,475,524.08

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	25,217,944.90	26,013,769.47
第二层次	-	8,774.00
第三层次	-	-
合计	25,217,944.90	26,022,543.47

###### 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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 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

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	权益投资	24,269,383.51	51.91
	其中：股票	24,269,383.51	51.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	948,561.39	2.03
	其中：债券	948,561.39	2.03
	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	21,509,957.81	46.01
8	其他各项资产	23,849.07	0.05
9	合计	46,751,751.78	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	20,498,256.94	44.18
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	94,221.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,549,837.01	5.50
J	金融业	1,066,815.00	2.30
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	60,253.56	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	24,269,383.51	52.31

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)	占基金资产净值比例(%)
1	603893	瑞芯微	44,300	2,621,231.00	5.65
2	688107	安路科技	64,031	1,627,668.02	3.51

3	688522	纳睿雷达	27,986	1,311,983.68	2.83
4	600109	国金证券	141,300	1,066,815.00	2.30
5	688183	生益电子	51,680	1,001,558.40	2.16
6	301165	锐捷网络	30,100	898,184.00	1.94
7	688486	龙迅股份	14,800	848,040.00	1.83
8	600105	永鼎股份	186,000	691,920.00	1.49
9	688157	松井股份	19,365	666,156.00	1.44
10	301303	真兰仪表	57,400	661,248.00	1.43
11	301377	鼎泰高科	37,500	658,125.00	1.42
12	688798	艾为电子	10,251	580,411.62	1.25
13	301070	开勒股份	13,000	547,430.00	1.18
14	600584	长电科技	16,700	529,557.00	1.14
15	002415	海康威视	15,200	469,832.00	1.01
16	688313	仕佳光子	48,161	458,492.72	0.99
17	603986	兆易创新	4,700	449,414.00	0.97
18	301121	紫建电子	9,300	343,449.00	0.74
19	600862	中航高科	17,700	332,406.00	0.72
20	688300	联瑞新材	6,852	329,581.20	0.71
21	688004	博汇科技	28,496	312,031.20	0.67
22	300687	赛意信息	21,900	304,848.00	0.66
23	600760	中航沈飞	7,300	292,730.00	0.63
24	300408	三环集团	9,500	277,305.00	0.60
25	002179	中航光电	7,030	267,491.50	0.58
26	688150	莱特光电	12,904	250,337.60	0.54
27	688031	星环科技	6,750	247,792.50	0.53
28	300395	菲利华	8,000	246,000.00	0.53
29	301272	英华特	5,700	219,906.00	0.47
30	688252	天德钰	14,544	211,324.32	0.46
31	688558	国盛智科	10,767	198,974.16	0.43
32	001332	锡装股份	8,310	197,944.20	0.43
33	688138	清溢光电	8,997	193,435.50	0.42

34	603296	华勤技术	3,440	189,991.20	0.41
35	301391	卡莱特	4,180	183,000.40	0.39
36	688401	路维光电	6,802	178,212.40	0.38
37	688110	东芯股份	9,100	173,537.00	0.37
38	688205	德科立	5,737	165,282.97	0.36
39	002025	航天电器	3,400	157,692.00	0.34
40	688719	爱科赛博	5,970	155,637.90	0.34
41	301328	维峰电子	4,200	155,022.00	0.33
42	688220	翱捷科技	4,019	150,551.74	0.32
43	603931	格林达	7,400	150,442.00	0.32
44	688416	恒烁股份	3,773	143,260.81	0.31
45	688143	长盈通	6,202	132,846.84	0.29
46	301270	汉仪股份	5,300	127,889.00	0.28
47	300034	钢研高纳	8,000	127,120.00	0.27
48	002281	光迅科技	3,200	119,584.00	0.26
49	301517	陕西华达	2,200	118,800.00	0.26
50	688702	盛科通信	2,896	117,288.00	0.25
51	688981	中芯国际	2,479	114,281.90	0.25
52	688305	科德数控	1,766	113,836.36	0.25
53	688484	南芯科技	2,913	108,072.30	0.23
54	603738	泰晶科技	7,780	106,119.20	0.23
55	000988	华工科技	3,500	104,755.00	0.23
56	000636	风华高科	7,700	100,562.00	0.22
57	002139	拓邦股份	9,100	96,642.00	0.21
58	001287	中电港	5,700	94,221.00	0.20
59	688539	高华科技	3,242	87,242.22	0.19
60	002402	和而泰	7,800	83,538.00	0.18
61	000733	振华科技	2,000	83,060.00	0.18
62	300793	佳禾智能	5,500	76,230.00	0.16
63	002881	美格智能	3,700	73,408.00	0.16
64	688521	芯原股份	2,500	66,875.00	0.14

65	688372	伟测科技	1,532	60,253.56	0.13
66	001283	豪鹏科技	1,400	59,780.00	0.13
67	688625	呈和科技	1,541	56,030.76	0.12
68	603160	汇顶科技	800	55,000.00	0.12
69	002916	深南电路	500	52,885.00	0.11
70	688387	信科移动	9,593	48,348.72	0.10
71	601698	中国卫通	3,400	47,906.00	0.10
72	001308	康冠科技	2,000	45,000.00	0.10
73	688668	鼎通科技	1,093	42,943.97	0.09
74	688322	奥比中光	1,547	41,320.37	0.09
75	002790	瑞尔特	4,300	38,829.00	0.08
76	603267	鸿远电子	1,100	37,510.00	0.08
77	300394	天孚通信	420	37,136.40	0.08
78	300496	中科创达	800	36,472.00	0.08
79	688631	莱斯信息	546	33,862.92	0.07
80	001309	德明利	390	33,696.00	0.07
81	300976	达瑞电子	600	27,510.00	0.06
82	002138	顺络电子	1,000	27,460.00	0.06
83	301329	信音电子	1,400	27,062.00	0.06
84	688475	萤石网络	700	23,877.00	0.05
85	301387	光大同创	700	23,450.00	0.05
86	688036	传音控股	280	21,431.20	0.05
87	688508	芯朋微	561	20,403.57	0.04
88	688083	中望软件	280	20,333.60	0.04
89	300042	朗科科技	1,000	20,190.00	0.04
90	603138	海量数据	1,900	19,912.00	0.04
91	688776	国光电气	339	18,780.60	0.04
92	301421	波长光电	400	17,292.00	0.04
93	600183	生益科技	700	14,742.00	0.03
94	688629	华丰科技	524	13,812.64	0.03
95	688292	浩瀚深度	800	12,368.00	0.03

96	000021	深科技	800	12,096.00	0.03
97	688079	美迪凯	1,147	8,510.74	0.02
98	600563	法拉电子	100	7,618.00	0.02
99	301191	菲菱科思	100	6,997.00	0.02
100	688337	普源精电	200	5,044.00	0.01
101	688515	裕太微	83	4,814.00	0.01
102	603662	柯力传感	200	4,668.00	0.01
103	600536	中国软件	130	3,889.60	0.01
104	300629	新劲刚	200	3,532.00	0.01
105	688141	杰华特	200	3,232.00	0.01
106	300895	铜牛信息	100	2,483.00	0.01
107	603068	博通集成	100	2,276.00	0.00

#### 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	301377	鼎泰高科	518,587.00	0.88
2	301070	开勒股份	476,804.00	0.81
3	688313	仕佳光子	470,811.14	0.80
4	603296	华勤技术	424,421.00	0.72
5	600862	中航高科	352,794.00	0.60
6	600584	长电科技	329,766.00	0.56
7	688300	联瑞新材	303,005.78	0.52
8	603986	兆易创新	297,823.00	0.51
9	688631	莱斯信息	245,344.95	0.42
10	300395	菲利华	236,548.00	0.40
11	301165	锐捷网络	231,109.00	0.39
12	300782	卓胜微	221,890.00	0.38

13	600760	中航沈飞	221,831.00	0.38
14	688150	莱特光电	201,338.55	0.34
15	688138	清溢光电	190,211.89	0.32
16	688719	爱科赛博	188,817.44	0.32
17	301391	卡莱特	187,831.00	0.32
18	688220	翱捷科技	154,279.02	0.26
19	001332	锡装股份	149,575.00	0.25
20	002790	瑞尔特	146,616.00	0.25

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(%)
1	688631	莱斯信息	764,225.33	1.30
2	300782	卓胜微	744,542.00	1.27
3	301517	陕西华达	707,514.00	1.21
4	002415	海康威视	702,200.00	1.20
5	001308	康冠科技	548,531.00	0.93
6	688322	奥比中光	546,347.73	0.93
7	002790	瑞尔特	432,322.00	0.74
8	688515	裕太微	428,346.00	0.73
9	603296	华勤技术	296,063.00	0.50
10	688629	华丰科技	172,106.64	0.29
11	002222	福晶科技	117,579.00	0.20
12	300042	朗科科技	98,303.00	0.17
13	301391	卡莱特	92,795.00	0.16
14	301318	维海德	84,577.00	0.14
15	688521	芯原股份	53,564.87	0.09

16	300895	铜牛信息	20,592.00	0.04
17	688435	英方软件	6,206.00	0.01
18	300511	雪榕生物	750.00	0.00

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	8,014,461.35
卖出股票收入（成交）总额	5,816,564.57

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	948,561.39	2.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	948,561.39	2.04

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	110047	山鹰转债	5,210	493,802.37	1.06
2	123078	飞凯转债	2,030	230,222.58	0.50
3	113616	韦尔转债	2,000	224,536.44	0.48

**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**

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

**7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

**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	4,020.95
2	应收清算款	-
3	应收股利	-



4	应收利息	-
5	应收申购款	19,828.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,849.07

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110047	山鹰转债	493,802.37	1.06
2	123078	飞凯转债	230,222.58	0.50
3	113616	韦尔转债	224,536.44	0.48

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末持有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 (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
先锋量化	9,566	3,260.26	67,953.05	0.2200%	31,119,709.74	99.7800%

优选A						
先锋 量化 优选C	851	3,669.77	0.00	0.00%	3,122,972.86	100.000 0%
合计	10, 417	3,293.72	67,953.05	0.200 0%	34,242,682.60	99.800 0%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	先锋量化优选A	6,613.15	0.0212%
	先锋量化优选C	882.73	0.0283%
	合计	7,495.88	0.0218%

### 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	先锋量化优选A	0~10
	先锋量化优选C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	先锋量化优选A	0
	先锋量化优选C	0~10
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	先锋量化优选A	先锋量化优选C
基金合同生效日(2019年05月15 日)基金份额总额	20,000,657.44	182,510,637.51

本报告期期初基金份额总额	34,030,714.10	6,619,688.16
本报告期基金总申购份额	2,362,546.41	263,278.53
减：本报告期基金总赎回份额	5,205,597.72	3,759,993.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,187,662.79	3,122,972.86

## §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无重大人事变动。

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

本报告期内本基金未改聘为其审计的会计事务所。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到相关监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	13,831,025.92	100.00%	7,455.73	100.00%	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-

中山证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》、《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》等相关法律法规要求，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)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。
- (3)基金管理人根据证券公司交易单元交易量依据公司投研部门对证券公司投研服务的综合评分排名结果进行分配。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	761,192.40	100.00%	168,687,000.00	100.00%	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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旗下基金季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-01-22
2	先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金2023年第4季度报告	基金管理人网站、证监会指定网站	2024-01-22
3	先锋基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2024-02-29
4	先锋基金管理有限公司旗下基金年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-03-29
5	先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金2023年年度报告	基金管理人网站、证监会指定网站	2024-03-29
6	先锋基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-04-22
7	先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金2024年第1季度报告	基金管理人网站、证监会指定网站	2024-04-22
8	先锋基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新基金产品资料概要的提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-06-29

9	先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站、证监会指定网站	2024-06-29
---	-------------------------------	-----------------	------------

### §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

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

#### 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

1.1 中国证券监督管理委员会批准先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

1.2 《先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

1.3 《先锋量化优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

1.5 报告期内先锋量化优选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、基金托管人处。

#### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人先锋基金管理有限公司

官方网站：<http://www.xf-fund.com>

先锋基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日