

先锋日添利货币市场基金

2021年第2季度报告

2021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:渤海银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年04月01日起至2021年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	先锋日添利	
基金主代码	004151	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年04月14日	
报告期末基金份额总额	774,172,635.54份	
投资目标	在控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将根据宏观经济走势、货币政策、短期资金市场状况等因素对利率走势进行综合判断，并根据利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。	
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	先锋基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	先锋日添利A	先锋日添利B

下属分级基金的交易代码	004151	004152
报告期末下属分级基金的份额总额	120,685,380.58份	653,487,254.96份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 主要财务指标_本期

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年04月01日 - 2021年06月30日)	
	先锋日添利A	先锋日添利B
1. 本期已实现收益	872,830.40	2,894,309.70
2. 本期利润	872,830.40	2,894,309.70
3. 期末基金资产净值	120,685,380.58	653,487,254.96

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.1.2 主要财务指标_上期

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年01月01日 - 2021年03月31日)	
	先锋日添利A	先锋日添利B
1. 本期已实现收益	1,117,418.77	6,136,059.83
2. 本期利润	1,117,418.77	6,136,059.83
3. 期末基金资产净值	232,850,938.62	885,360,794.50

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

先锋日添利A净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个	0.5970%	0.0029%	0.3413%	0.0000%	0.2557%	0.0029%

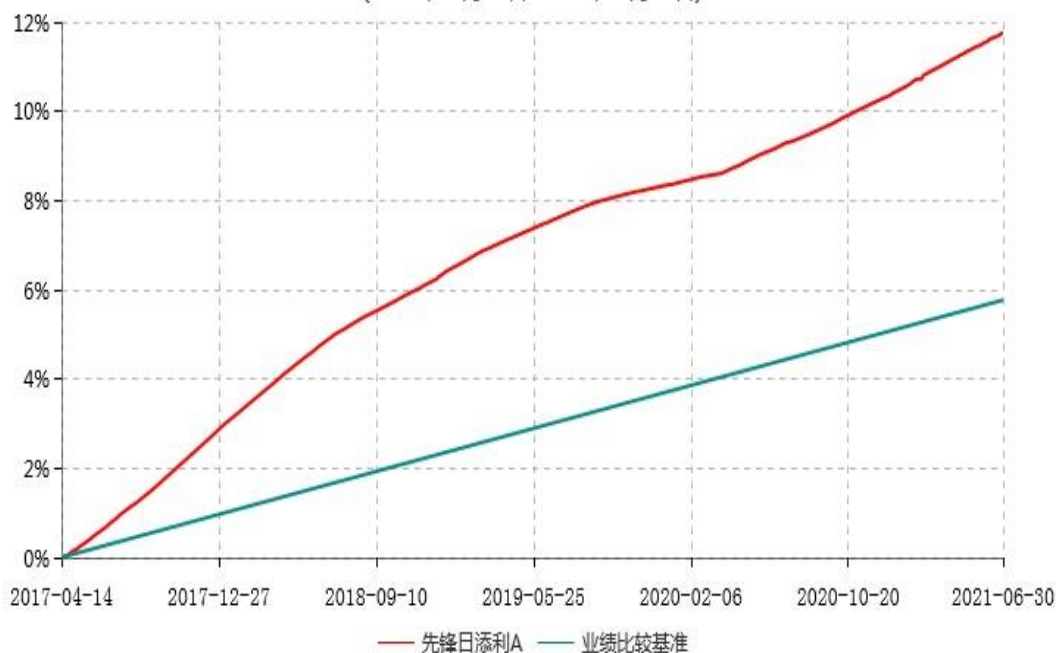
月						
过去六个月	1.2356%	0.0048%	0.6788%	0.0000%	0.5568%	0.0048%
过去一年	2.3266%	0.0035%	1.3688%	0.0000%	0.9578%	0.0035%
过去三年	6.4868%	0.0027%	4.1100%	0.0000%	2.3768%	0.0027%
自基金合同生效起至今	11.7624%	0.0035%	5.7713%	0.0000%	5.9911%	0.0035%

先锋日添利B净值表现

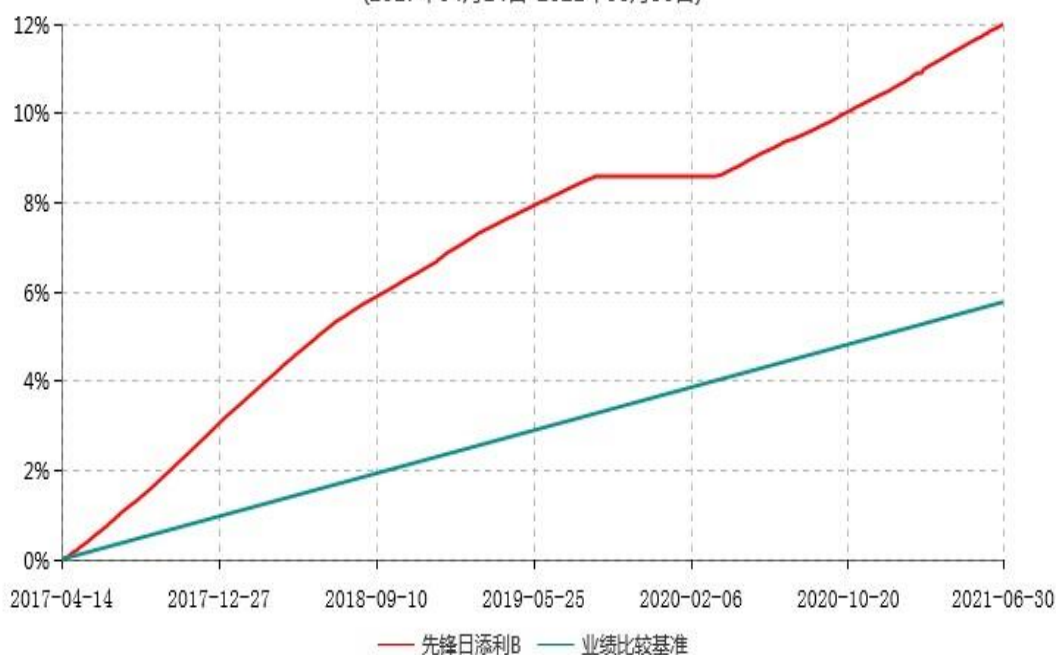
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6324%	0.0029%	0.3413%	0.0000%	0.2911%	0.0029%
过去六个月	1.3057%	0.0048%	0.6788%	0.0000%	0.6269%	0.0048%
过去一年	2.4700%	0.0035%	1.3688%	0.0000%	1.1012%	0.0035%
过去三年	6.3991%	0.0036%	4.1100%	0.0000%	2.2891%	0.0036%
自基金合同生效起至今	11.9986%	0.0042%	5.7713%	0.0000%	6.2273%	0.0042%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

先锋日添利A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年04月14日-2021年06月30日)



先锋日添利B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年04月14日-2021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“投资范围”、“投资限制”的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基	证	说明
----	----	--------	---	----

		基金经理期限		券从业年限	
		任职日期	离任日期		
杜旭	投资管理部固收总监、基金经理	2020-02-24	-	11年	金融学硕士，现任公司投资管理部固收总监、基金经理。2010年至2019年先后任第一创业证券固定收益部交易员，华润信托债券投资经理、融通资本固定收益高级投资经理，2019年8月加入先锋基金从事投资研究工作。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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》。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，经济延续恢复态势，但恢复仍不均衡、基础不稳固。PPI虽然上升到高位，但主要是大宗商品价格传导和基数效应的影响，CPI仍然保持低位，物价能否向下游有效传导仍需观察。在此条件下，央行不急于收紧货币政策，仍然保持稳健的政策基调，流动性合理充裕；资金价格受地方债发行、季末时点等因素影响有所波动，整体仍维持在较低水平。

展望未来，我们认为短期内央行货币政策仍不急于收紧，未来将继续观察经济恢复的持续性以及涨价能否向中下游、CPI传导，力图推动经济在恢复中达到更高水平均衡。另一方面，上半年地方债发行进度不及预期，下半年地方债发行节奏可能加快，叠加经济仍在向上恢复之中，预计资金面波动将加大，价格中枢可能逐步上移。我们将继续稳健操作，力争在保障安全性、流动性的情况下，为客户创造良好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末先锋日添利A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.5970%，同期业绩比较基准收益率为0.3413%；截至报告期末先锋日添利B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.6324%，同期业绩比较基准收益率为0.3413%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	561,720,587.89	68.96
	其中：债券	561,720,587.89	68.96
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	167,500,770.75	20.56
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	27,141,584.29	3.33
4	其他资产	58,186,565.09	7.14
5	合计	814,549,508.02	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	3.51
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	40,019,819.97	5.17

其中：买断式回购融资	-	-
------------	---	---

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

无

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	26
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限没有超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	70.56	5.17
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	15.49	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	10.36	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	1.29	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	97.70	5.17

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期没有超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,954,451.62	1.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,982,606.43	3.87
	其中：政策性金融债	29,982,606.43	3.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	122,034,133.25	15.76
6	中期票据	40,325,576.48	5.21
7	同业存单	359,423,820.11	46.43
8	其他	-	-
9	合计	561,720,587.89	72.56
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112003126	20农业银行C D126	600,000	59,910,655.37	7.74
2	112006124	20交通银行C D124	500,000	49,944,404.55	6.45
3	112116096	21上海银行C D096	500,000	49,939,739.77	6.45
4	112111114	21平安银行C D114	500,000	49,931,367.59	6.45
5	112017172	20光大银行C D172	500,000	49,872,398.40	6.44
6	012101525	21中化股SCP 015	300,000	30,008,565.38	3.88
7	200216	20国开16	300,000	29,982,606.43	3.87
8	112003131	20农业银行C	300,000	29,946,901.28	3.87

		D131			
9	112010301	20兴业银行C D301	300,000	29,935,199.38	3.87
10	101469018	14京汽MTN00 1	200,000	20,233,409.71	2.61

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0888%
报告期内偏离度的最低值	0.0307%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0514%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持1.00元。

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

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,395.64
2	应收证券清算款	-

3	应收利息	2,625,961.16
4	应收申购款	55,545,208.29
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	58,186,565.09

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	先锋日添利A	先锋日添利B
报告期期初基金份额总额	232,850,938.62	885,360,794.50
报告期期间基金总申购份额	122,255,501.83	856,705,814.81
报告期期间基金总赎回份额	234,421,059.87	1,088,579,354.35
报告期期末基金份额总额	120,685,380.58	653,487,254.96

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210401 - 20210614 20210617 - 20210629	253,412,438.08	53,180,609.03	203,614,694.41	102,978,352.70	13.30%
	2	20210630 - 20210630	1,074,019.02	295,301,782.23	1,075,801.25	295,300,000.00	38.14%
	3	20210401 - 20210414	293,024,527.57	930,145.76	293,354,673.33	600,000.00	0.08%
产品特有风险							
<p>(1) 特定投资者大额赎回导致的流动性风险 如果特定投资者大额赎回，为应对赎回，可能迫使基金以不适当的价格大量抛售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。</p> <p>(2) 特定投资者大额赎回导致的巨额赎回风险 如果特定投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请。</p> <p>(3) 特定投资者大额赎回导致的基金资产净值较低的风险 如果特定投资者大额赎回导致基金资产净值较低，可能出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，继而触发</p>							

基金合同终止条件导致基金无法继续存续。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证券监督管理委员会批准先锋日添利货币市场基金设立的文件
- 9.1.2 《先锋日添利货币市场基金基金合同》
- 9.1.3 《先锋日添利货币市场基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 报告期内先锋日添利货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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

2021年07月21日