
先锋日添利货币市场基金

2021年第3季度报告

2021年09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10月27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10月26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07月01日起至2021年09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	425,237,259.09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	188,052,477.05份	237,184,782.04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07月01日 - 2021年09月30日)	
	先锋日添利A	先锋日添利B
1. 本期已实现收益	1,144,474.01	2,252,555.58
2. 本期利润	1,144,474.01	2,252,555.58
3. 期末基金资产净值	188,052,477.05	237,184,782.04

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

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	0.6558%	0.0063%	0.3450%	0.0000%	0.3108%	0.0063%

月						
过去六个月	1.2567%	0.0049%	0.6863%	0.0000%	0.5704%	0.0049%
过去一年	2.4845%	0.0047%	1.3688%	0.0000%	1.1157%	0.0047%
过去三年	6.4606%	0.0033%	4.1100%	0.0000%	2.3506%	0.0033%
自基金合同生效起至今	12.4953%	0.0037%	6.1163%	0.0000%	6.3790%	0.0037%

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	0.6911%	0.0063%	0.3450%	0.0000%	0.3461%	0.0063%
过去六个月	1.3279%	0.0049%	0.6863%	0.0000%	0.6416%	0.0049%
过去一年	2.6275%	0.0047%	1.3688%	0.0000%	1.2587%	0.0047%
过去三年	6.3453%	0.0040%	4.1100%	0.0000%	2.2353%	0.0040%
自基金合同生效起至今	12.7726%	0.0043%	6.1163%	0.0000%	6.6563%	0.0043%

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09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09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	2020-02-04	-	11年	金融学硕士，1987年2月生，2010年毕业于中南财经政法大学，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

三季度，GDP增速略有下行，PPI高涨。出口增速有所下行，但仍保持较高位置，对投资有一定带动作用。国内疫情时有爆发对服务业消费影响较大，叠加乘用车销量下降，消费增长乏力。投资方面，部分地产企业风险舆情发酵，商品房销售、拿地增速明显下滑，投资增速下行较快；隐性债务控制严格，基建投资并未发力；制造业投资在出口、消费带动下增长稳定，但原材料涨价、碳排放等因素对生产形成制约，导致制造业盈利

预期不明朗，对投资恢复带来一定不利影响。物价方面，PPI 仍然维持高位，猪价拖累 CPI 保持低位，物价继续向中下游传导。整体来看，经济恢复仍不均衡、基础不稳固，央行仍有稳经济的需求；另一方面，供给不足导致的物价高涨，并可能向中下游传导，也对货币政策形成一定掣肘。央行仍然保持稳健的政策基调，保持“结构性流动性短缺”的政策框架，7 月份虽有降准 0.5 个百分点，但跨月、跨季资金成本仍然较高。受资金成本影响，存单收益也波动较大，7 月降准之后 1 年大行/股份行存单收益从 2.75% 逐步下降至 2.65%，但之后受地方债发行、月末时点因素冲击，随着季末时点的到来，收益率上行至 2.8% 左右。

报告期内，本基金结合负债端情况，在保证组合流动性的前提下，以存单、逆回购为主进行交易和配置操作，同时配置少量信用债，整体实现了相对较好的收益。

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 0.6558%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%；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 0.6911%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%。

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	358,959,381.89	84.34
	其中：债券	358,959,381.89	84.34
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	63,002,494.50	14.80
	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	3,181,543.56	0.75
4	其他资产	487,106.20	0.11
5	合计	425,630,526.15	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	-	3.23
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

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	64.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.06	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	2.33	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

5	120天(含)—397天(含)	18.70	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.98	-

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,017,272.98	7.06
	其中：政策性金融债	30,017,272.98	7.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,000,283.59	4.70
6	中期票据	-	-
7	同业存单	308,941,825.32	72.65
8	其他	-	-
9	合计	358,959,381.89	84.41
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	112008273	20中信银行C D273	500,000	49,914,885.44	11.74
2	112106213	21交通银行C D213	500,000	49,914,874.45	11.74
3	210206	21国开06	300,000	30,017,272.98	7.06
4	112110029	21兴业银行C D029	300,000	29,963,764.10	7.05
5	112011268	20平安银行C	300,000	29,960,743.21	7.05

		D268			
6	112110292	21兴业银行C D292	300,000	29,958,776.22	7.05
7	112009494	20浦发银行C D494	300,000	29,901,873.68	7.03
8	112108039	21中信银行C D039	300,000	29,897,537.47	7.03
9	112115046	21民生银行C D046	300,000	29,677,850.37	6.98
10	012103109	21云投SCP01 4	200,000	20,000,283.59	4.70

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	0.0856%
报告期内偏离度的最低值	-0.0573%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0402%

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	455,591.26
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	31,514.94
7	其他	-
8	合计	487,106.20

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	120,685,380.58	653,487,254.96
报告期期间基金总申购份额	364,545,064.07	862,488,585.89
报告期期间基金总赎回份额	297,177,967.60	1,278,791,058.81
报告期期末基金份额总额	188,052,477.05	237,184,782.04

§ 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	20210705 - 20210706 20210727 - 20210728	102,985,455.22	28,422,809.55	131,408,264.77	-	0.00%
	2	20210701 - 20210701	295,320,388.68	1,618,971.44	296,939,360.12	-	0.00%

		10704					
3	20210827 - 20210901		-	100,047,621.14	100,047,621.14	-	0.00%
产品特有风险							
<p>(1) 特定投资者大额赎回导致的流动性风险 如果特定投资者大额赎回，为应对赎回，可能迫使基金以不适当的价格大量抛售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。</p> <p>(2) 特定投资者大额赎回导致的巨额赎回风险 如果特定投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请。</p> <p>(3) 特定投资者大额赎回导致的基金资产净值较低的风险 如果特定投资者大额赎回导致基金资产净值较低，可能出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，继而触发基金合同终止条件导致基金无法继续存续。</p>							

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10月27日