

先锋日添利货币市场基金

2022年第3季度报告

2022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:2022年10月26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2022年10月24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2022年07月1日起至2022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	85,722,949.14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	68,573,129.89份	17,149,819.25份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年07月01日 - 2022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	244,941.50	85,674.53
2. 本期利润	244,941.50	85,674.53
3. 期末基金资产净值	68,573,129.89	17,149,819.25

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。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
过去三个月	0.3213%	0.0004%	0.3450%	0.0000%	-0.0237%	0.0004%
过去六个月	0.7269%	0.0008%	0.6863%	0.0000%	0.0406%	0.0008%
过去一年	1.8013%	0.0031%	1.3688%	0.0000%	0.4325%	0.0031%
过去三年	5.9795%	0.0035%	4.1100%	0.0000%	1.8695%	0.0035%
过去五年	12.5255%	0.0036%	6.8475%	0.0000%	5.6780%	0.0036%
自基金合同生效起至今	14.5217%	0.0037%	7.4850%	0.0000%	7.0367%	0.0037%

注：本基金收益分配按日结转份额

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	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
----	--------	----------	-----------	-----------	-----	-----

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	0.3568%	0.0004%	0.3450%	0.0000%	0.0118%	0.0004%
过去六个月	0.7977%	0.0008%	0.6863%	0.0000%	0.1114%	0.0008%
过去一年	1.9330%	0.0031%	1.3688%	0.0000%	0.5642%	0.0031%
过去三年	5.8618%	0.0040%	4.1100%	0.0000%	1.7518%	0.0040%
过去五年	12.8194%	0.0041%	6.8475%	0.0000%	5.9719%	0.0041%
自基金合同 生效起至今	14.9525%	0.0042%	7.4850%	0.0000%	7.4675%	0.0042%

注：本基金收益分配按日结转份额

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





注：1：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；

2：2022 年 3 月 8 日 B 类基金份额为零且停止计算 B 类基金份额净值和基金份额累计净值。

§ 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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		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	-	12 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，20

					19年8月加入先锋基金从事投资研究工作。
黄意球	基金经理	2022-07-18	-	6年	中国科学院博士，曾任大公国际资信评估有限公司信用分析师、吉祥人寿保险股份有限公司信用评估经理、平安基金管理有限公司固定收益研究员。2021年5月加入先锋基金管理有限公司任基金经理助理。

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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《先锋基金管理有限公司公平交易制度》，并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，确保公平对待公司旗下的全部投资组合。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，国内疫情仍然时有爆发，政府坚持“动态清零”，并出台多项措施稳定经济增长，金融、经济相对二季度呈修复态势。投资方面，地产销售仍然低迷、投资增速进一步下滑，基建投资增速上行，制造业投资也有较强韧性，整体投资增速相对二季度有所好转；国内精准防控一定程度上减少了对居民消费的干扰，叠加汽车购置税减免等消费刺激政策，消费增速持续恢复；美联储货币政策收紧，俄乌冲突扰乱欧洲经济，海外需求下行，中国出口增速开始下行。物价方面，原油价格下行，铜铝等大宗商品价格低位震荡，国内PPI持续下行至较低水平；国内猪价底部反弹，带动CPI持续上行，需保

持关注。财政上依法盘活5000亿元专项债结存限额，要求10月底前发行完毕；货币政策保持宽松，引导MLF下行和LPR结构性下行，因城施策下调房贷利率，下调公积金贷款利率，支持地产等实体经济，政策性银行信贷和央行专项再贷款也逐步投放。政策刺激下，企业中长期贷款增速上行，金融数据已有明显改善，后续需观察其持续性。整体看，三季度疫情、地产仍然制约经济增长，货币政策保持宽松，资金成本保持低位，存单收益也在低位震荡。

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，整体实现了稳定收益。

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0.3213%，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0.3568%，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	80,304,351.84	93.49
	其中：债券	80,304,351.84	93.49
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	5,593,954.83	6.51
4	其他资产	-	-
5	合计	85,898,306.67	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	46
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	47
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	7

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	41.48	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	58.63	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.11	-

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	60,326,557.71	70.37
	其中：政策性金融债	60,326,557.71	70.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,977,794.13	23.31
8	其他	-	-
9	合计	80,304,351.84	93.68
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	200217	20国开17	500,000	50,336,547.75	58.72
2	2203684	22进出684	100,000	9,990,009.96	11.65
3	112103134	21农业银行C D134	100,000	9,989,766.31	11.65
4	112210033	22兴业银行C D033	100,000	9,988,027.82	11.65

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	0.0263%
报告期内偏离度的最低值	-0.0135%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0133%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内，本基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内，本基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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，国家开发银行、中国进出口银行、兴业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到银保监会处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

5.9.3 其他资产构成

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	87,430,383.37	17,773,284.66
报告期期间基金总申购份额	2,964,636.08	11,378,145.55
报告期期间基金总赎回份额	21,821,889.56	12,001,610.96
报告期期末基金份额总额	68,573,129.89	17,149,819.25

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2022-07-08	6,070,000.00	6,070,000.00	-
2	赎回	2022-09-28	1,700,000.00	-1,700,000.00	-
合计			7,770,000.00	4,370,000.00	

注：基金管理人本期运用自有资金投资本基金均为本基金的B类基金份额。

§ 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

无

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

2022年10月26日