

中航航行宝货币市场基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2021 年 3 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。本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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于 2021 年 3 月 25 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及其更新。

本报告中财务资料已经经过天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 债券回购融资情况.....	49
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	49
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	51

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	52
8.8 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.....	52
8.9 投资组合报告附注.....	52
§9 基金份额持有人信息.....	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
9.4 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的情况.....	58
§10 开放式基金份额变动.....	60
§11 重大事件揭示.....	61
11.1 基金份额持有人大会决议.....	61
11.2 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.....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	63
11.9 其他重大事件.....	63
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
12.1 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.....	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§13 备查文件目录.....	66
13.1 备查文件目录.....	66
13.2 存放地点.....	66
13.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中航航空宝货币市场基金
基金简称	中航航空宝
基金主代码	004133
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日
基金管理人	中航基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	211,395,242.68 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险和保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金采取资产配置策略、个券选择策略、利用短期市场机会的灵活策略、资产支持证券投资策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等,以及各投资品种的市场规模、交易活跃程度、相对收益、信用等级、平均到期期限等重要指标的综合判断,并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征,决定基金资产在债券、银行存款、资产支持证券等各类资产的配置比例,并适时进行动态调整。</p> <p>2、个券选择策略</p> <p>在考虑安全性因素的前提下,本基金管理人将积极发掘</p>

价格被低估的且符合流动性要求的适合投资的品种。通过分析各个具体金融产品的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级状况、流动性指标等因素进行证券选择，选择风险收益配比最合理的证券作为投资对象。

3、利用短期市场机会的灵活策略

由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡；新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因，研究其中的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会获得超额收益。

4、资产支持证券投资策略

本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。

5、回购策略

根据回购市场利率走势变化情况，在回购利率较低时，本基金在严格遵守相关法律法规的前提下，利用正回购操作循环融入资金进行债券投资，提高基金收益水平。另一方面，本基金将把握资金供求的瞬时效应，积极捕捉收益率峰值的短线机会。在回购利率突增的情况下，本基金可通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。

6、现金流管理策略

出于较高的流动性要求，本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基

	金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，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。

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		中航基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武国强	胡凯
	联系电话	010-50867188	021-38037354
	电子邮箱	wuguoqiang@avicfund.cn	hukai@gtjas.com
客户服务电话		400-666-2186	021-38917599-5
传真		010-56793194	021-38677819
注册地址		北京市朝阳区安立路 78、80 号 11 层 1101 内 1105 室	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址		北京市朝阳区安立路 78、80 号 11 层 1101 内 1105 室	上海市静安区新闸路 669 号博华广场 19 楼
邮政编码		100101	200041
法定代表人		洪正华	贺青

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼
注册登记机构	中航基金管理有限公司	北京市朝阳区安立路 78、80 号 11 层 1101 内 1105 室

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	3,279,077.97	4,124,666.58	10,026,879.80
本期利润	3,279,077.97	4,124,666.58	10,026,879.80
本期净值收益率	1.8512%	2.2391%	3.2628%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末基金资产净值	211,395,242.68	106,398,504.69	312,214,609.41
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
累计净值收益率	11.2880%	9.2653%	6.8724%

①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

②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，由于货币市场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本基金每日分配收益，按日结转份额。

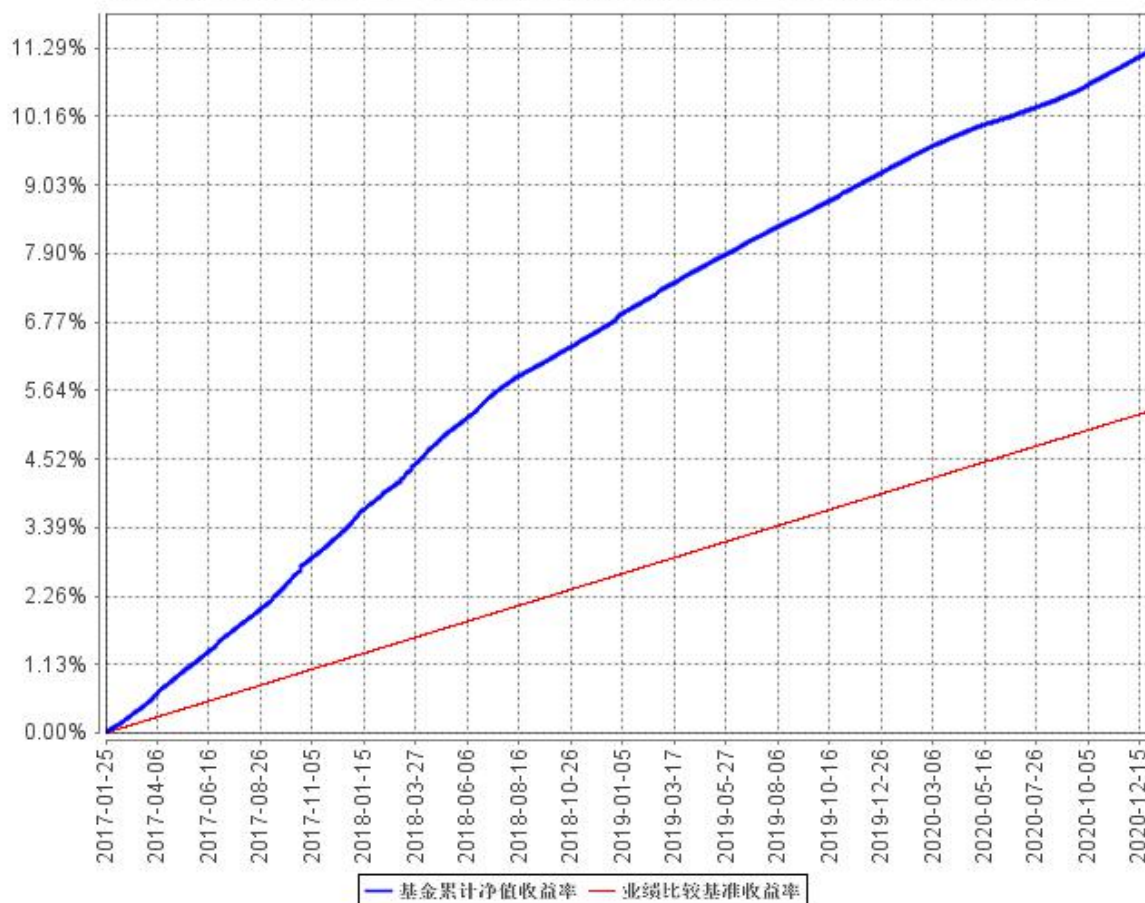
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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	0.5852%	0.0025%	0.3403%	0.0000%	0.2449%	0.0025%
过去六个月	0.9831%	0.0021%	0.6805%	0.0000%	0.3026%	0.0021%
过去一年	1.8512%	0.0016%	1.3537%	0.0000%	0.4975%	0.0016%
过去三年	7.5293%	0.0033%	4.0537%	0.0000%	3.4756%	0.0033%
自基金合同 生效起至今	11.2880%	0.0038%	5.3149%	0.0000%	5.9731%	0.0038%

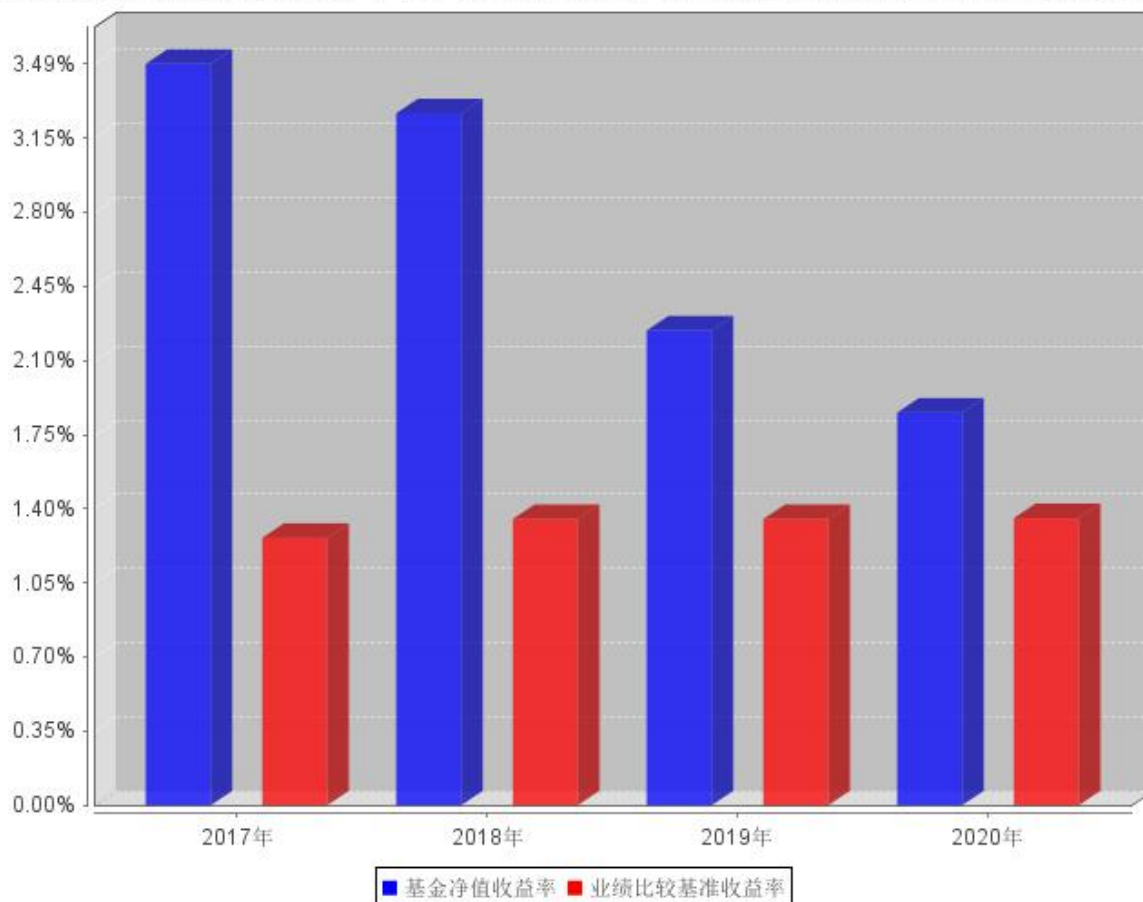
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2020	3,271,430.95	-	7,647.02	3,279,077.97	
2019	4,271,884.22	-	-147,217.64	4,124,666.58	
2018	9,988,253.36	-	38,626.44	10,026,879.80	
合计	17,531,568.53	-	-100,944.18	17,430,624.35	

本基金“每日分配收益，按日结转份额”。以每万份基金份额净收益为基准，每日为基金份额持有人计算当日收益并分配，每日支付收益。

§ 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

中航基金管理有限公司成立于 2016 年 6 月 16 日，是经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1249 号文许可批准设立、为客户提供专业基金管理服务的全国性基金管理公司。公司总部设在北京，注册资本为 30,000 万元人民币，经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截止 2020 年 12 月 31 日，基金管理人管理一只货币基金——中航航空宝货币市场基金，四只债券型基金——中航瑞景 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中航瑞明纯债债券型证券投资基金、中航瑞昱一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中航瑞晨 87 个月定期开放债券型证券投资基金，三只混合型证券投资基金——中航混改精选混合型证券投资基金、中航军民融合精选混合型证券投资基金、中航新起航灵活配置混合型证券投资基金。同时，管理多个特定客户资产投资组合。

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		
杜晓安	基金经理	2017 年 1 月 25 日	-	7	硕士研究生。曾供职于民生证券股份有限公司担任固定收益部交易经理、国都证券股份有限公司固定收益部投资经理。2016 年 9 月至今，担任中航基金管理有限公司固定收益部基金经理。
茅勇峰	基金经理	2018 年 6 月 15 日	-	3	硕士研究生。曾供职于中核财务有限责任公司先后担任

					稽核风险管理部风险管理岗、金融市场部投资分析岗、金融市场部副经理兼投资经理岗。 2017年8月至今，担任中航基金管理有限公司固定收益部基金经理。
--	--	--	--	--	---

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金发生投资组合的平均剩余期限超过 120 天的情形，本基金管理人已于 1 个工作日内调整完毕。除上述情况外，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《中航航空宝货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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，不存在违反基金合同和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 公平交易制度和控制方法

基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度。在统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。同时，加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合发生同日反向交易 633 次，不存在参与的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的 5% 的情形，同日反向交易均为量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2020 年一整年债券市场收益率是先下后上，走出了一波快速牛熊切换的反转行情，资金面也是从绝对宽松调整到精准导向，结构化宽松为主。疫情之后中国经济复苏态势是比较明确的，从“三驾马车”来看，出口是超预期，投资也发挥了重要的拉动作用，第四季度经济数据也有不错的表现，11 月债券收益率也上行到了近期高点，银行存单一级发行收益率也达到了今年高点。随后年底一方面一级债券供给减少，另一方面央行对于信用风险事件引发流动性的疏导，及对于跨年资金的呵护，使得债券市场的情绪转好，收益率小幅下行。随着近期收益率调整，债券收益率明显上行，性价比有所恢复，利率债和高等评级银行存单凸显了价高的配置价值。

在报告期内，本基金始终会坚持信用风险防范为第一位，配置始终以高评级有托管资格的同业存单为主要配置标的，择时增加了同业存单的配置比例，在跨年等资金利率提升的情况下，提高回购协议比例，适当增厚本基金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值收益率为 1.8512%，业绩比较基准收益率为 1.3537%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年疫情之后中国经济复苏态势明确，率先复工复产，出口是超预期，投资也发挥了重要的拉动作用，全年经济增长 2.3%，成为全球少有实现经济正增长的经济体。2020 年一整年债券市场收益率是先下后上，走出了一波快速牛熊切换的反转行情 11 月债券收益率上行到了今年顶点，银行存单一级发行收益率也达到了今年高点。随后年底一方面一级债券供给减少，另一方面央行对于信用风险事件引发流动性的疏导，及对于跨年资金的呵护，使得债券市场的情绪转好，收益率小幅下行。2021 年中央经济工作会议对于货币政策的定调是“不急转弯”，预计货币政策取向偏中性，维持紧平衡，宽松力度不如 2020 年，同时叠加人民币走强，加息的可能性也不大。财

政政策主基调偏积极，但是会逐渐回归常态化，由于 2020 年信用快速扩张，随着社融见顶，2021 年信用收缩可能比预期要强烈。预计 2021 年债券市场可能偏震荡走势，需谨防疫情反复、通胀风险，以及信用债集中违约风险等。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况，以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展内部监察稽核，完善合规与内控机制，积极推动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，有效保证了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序开展。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作如下：

(1) 内控环境：结合新法新规的实施和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，及时贯彻落实新法规及新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 合规与培训教育：通过现场合规培训和日常工作中新规传达解读等工作，提升员工的风险与合规意识，提高员工内部控制与风险管理的技能和水平，优化公司内部控制和风险管理基础。

(3) 法律事务：在公司新产品设计、新业务拓展工作中，就相关问题提供合规咨询、合规审查意见和建议。

(4) 信息披露：紧跟法规监管要求、市场变化和业务发展，不断优化完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、规范。

(5) 反洗钱：建立与行业和公司业务相匹配的洗钱风险管理体系，同时不断夯实反洗钱工作基础，做好反洗钱宣传培训、内部检查、信息报送等各项工作。

本基金管理人承诺将坚持诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由投资研究、交易、基金事务、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜

任能力和相关工作经历。报告期内，投资研究部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金应分配且已分配利润 3,279,077.97 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

4.9 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

报告期内未出现管理人对基金持有人数或基金资产净值预警情形。

§ 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

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在中航航空宝货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，发现个别监督指标不符合基金合同约定，本托管人已及时通知了基金管理人。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天职业字[2021]13622 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中航航空宝货币市场基金全体持有人：
审计意见	我们审计了中航航空宝货币市场基金（以下简称“中航航空宝货币基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照附注 7.4.2 的规定编制。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中航航空宝货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	我们与管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 中航航空宝货币基金财务报表仅为满足中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会的监管需要之目的而编制。因此，该财务报表可能不适用于其他用途。我们的报告仅用于供管理人报送中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会使用，而不应分发至除中航航空宝货币基金持有人、中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会以外的其他机构或人员或为其使用。本段内容不影响已发表的审计意见。
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	中航航空宝货币基金管理人中航基金管理有限公司（以下简称“管理人”）负责按照附注 7.4.2 的规定编制财务报表，并设计、执行

	和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 2. 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 3. 评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 4. 评价财务报表的总体列报、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 	
会计师事务所的名称	天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	丁启新	周任阳
会计师事务所的地址	北京市海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 23 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中航航空宝货币市场基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	11,963,504.94	2,360,913.87
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	148,813,474.05	79,610,424.09
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		148,813,474.05	79,610,424.09
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	49,980,194.97	19,696,269.54
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	311,429.80	262,996.48
应收股利		-	-
应收申购款		612,266.09	4,558,051.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		211,680,869.85	106,488,654.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		67,290.67	28,982.21
应付托管费		16,312.89	7,025.99
应付销售服务费		30,586.69	13,173.73
应付交易费用	7.4.7.7	7,478.07	5,346.59
应交税费		690.06	-
应付利息		-	-
应付利润		14,268.79	6,621.77
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	149,000.00	29,000.00
负债合计		285,627.17	90,150.29
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	211,395,242.68	106,398,504.69
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		211,395,242.68	106,398,504.69
负债和所有者权益总计		211,680,869.85	106,488,654.98

报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 211,395,242.68 份。

7.2 利润表

会计主体：中航航空宝货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

一、收入		4,420,931.80	5,322,861.11
1. 利息收入		4,375,295.25	5,278,004.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	205,013.58	93,646.97
债券利息收入		3,139,917.32	3,893,538.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,030,364.35	1,290,819.34
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		45,636.55	44,856.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	45,636.55	44,856.44
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		1,141,853.83	1,198,194.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	566,007.57	599,444.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	137,213.90	145,319.74
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	257,276.03	272,474.62
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		3,929.90	22,912.06
其中：卖出回购金融资产支出		3,929.90	22,912.06
6. 税金及附加		226.43	843.94
7. 其他费用	7.4.7.20	177,200.00	157,200.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,279,077.97	4,124,666.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,279,077.97	4,124,666.58

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中航航空宝货币市场基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	106,398,504.69	-	106,398,504.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,279,077.97	3,279,077.97
三、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）	104,996,737.99	-	104,996,737.99
其中：1. 基金申购款	654,531,139.88	-	654,531,139.88
2. 基金赎回款	-549,534,401.89	-	-549,534,401.89
四、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）	-	-3,279,077.97	-3,279,077.97
五、期末所有者权益（基金净值）	211,395,242.68	-	211,395,242.68

项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	312,214,609.41	-	312,214,609.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,124,666.58	4,124,666.58
三、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）	-205,816,104.72	-	-205,816,104.72
其中：1. 基金申购款	656,246,545.13	-	656,246,545.13
2. 基金赎回款	-862,062,649.85	-	-862,062,649.85
四、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）	-	-4,124,666.58	-4,124,666.58
五、期末所有者权益（基金净值）	106,398,504.69	-	106,398,504.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建

裴荣荣

韩丹

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中航航空宝货币市场基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2016]3041 号文《关于准予中航航空宝货币市场基金注册的批复》，由中航基金管理有限公司依照《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》和

《中航航行宝货币市场基金基金合同》（“基金合同”）等规定公开募集。经向中国证监会备案，于 2017 年 1 月 25 日募集成立。本基金的基金管理人为中航基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，基金合同生效日的基金份额总额为 520,655,938.43 份，有效认购户数为 324 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息折合基金份额 29,850.43 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中航航行宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(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。

基金目前以交易目的持有的债券投资、资产支持证券投资等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。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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。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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。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。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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；(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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金计价采用摊余成本法，估值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，在其收益期限内摊销，每日计提收益或损失。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按估值技术计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生不利影响，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的计价对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与采用影子定价计算的净值产生重大偏离时，基金管理人与基金托管人商定后按影子定价确定的公允价对其账面价值进行调整，并按影子定价进行后续计量，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。如基金份额净值恢复至 1.0000 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。

计算影子价格时按如下原则确定投资品种的公允价值：

(1) 对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额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，并将投资收益部分确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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。

7.4.4.9 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逐日确认。

其他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按直线法近似计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

- 1、本基金每份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- 3、每日收益分配：本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
- 4、本基金基金份额根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日

计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。在进行收益支付时，若基金已实现收益大于零，则增加基金份额持有人基金份额；若基金已实现收益等于零时，则保持基金份额持有人基金份额不变；若基金已实现收益小于零时，缩减基金份额持有人基金份额；

5、当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 04 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 基金运营过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税

方法，按照 3%的征收率缴纳增值税；

2. 基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加；

3. 对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税；

4. 存款利息收入不征收增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税；

5. 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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

6. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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；上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

7. 对基金取得的企业债券利息收入，应由各兑付机构在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；

8. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	11,963,504.94	2,360,913.87
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	11,963,504.94	2,360,913.87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	148,813,474.05	149,007,000.00	193,525.95	0.0915%
	合计	148,813,474.05	149,007,000.00	193,525.95	0.0915%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		148,813,474.05	149,007,000.00	193,525.95	0.0915%
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	79,610,424.09	79,649,000.00	38,575.91	0.0363%
	合计	79,610,424.09	79,649,000.00	38,575.91	0.0363%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		79,610,424.09	79,649,000.00	38,575.91	0.0363%

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	49,980,194.97	-

合计	49,980,194.97	-
项目	上年度末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	19,696,269.54	-
合计	19,696,269.54	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	3,105.38	1,460.28
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	304,128.28	249,128.77
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	4,196.14	12,407.43
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	311,429.80	262,996.48

其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	7,478.07	5,346.59
合计	7,478.07	5,346.59

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	149,000.00	29,000.00
合计	149,000.00	29,000.00

预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和银行间债券账户维护费。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,398,504.69	106,398,504.69
本期申购	654,531,139.88	654,531,139.88
本期赎回(以“-”号填列)	-549,534,401.89	-549,534,401.89
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	211,395,242.68	211,395,242.68

本期申购包含红利再投资、基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,279,077.97	-	3,279,077.97
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,279,077.97	-	-3,279,077.97
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	205,013.58	93,646.97
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	-	-
其他	-	-
合计	205,013.58	93,646.97

其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益——买卖股票差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	45,636.55	44,856.44
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	45,636.55	44,856.44

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	430,146,767.77	681,545,549.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	429,567,688.98	679,876,986.88
减：应收利息总额	533,442.24	1,623,706.30
买卖债券差价收入	45,636.55	44,856.44

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间本基金无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期及上年度可比期间本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期及上年度可比期间本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

本报告期及上年度可比期间本基金无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本报告期及上年度可比期间本基金无公允价值收益。

7.4.7.18 其他收入

本报告期及上年度可比期间本基金无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

本报告期及上年度可比期间本基金无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	177,200.00	157,200.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中航基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中航证券有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
北京首钢基金有限公司	基金管理人股东

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间本基金未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	566,007.57	599,444.17
其中：支付销售机构的客户维护费	49,936.63	37,107.72

①本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，于次月首日起3个工作日内按照双方约定的方式从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	137,213.90	145,319.74

①本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，于次月首日起 3 个工作日内按照双方约定的方式从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中航基金管理有限公司	199,747.80
国泰君安证券股份有限公司	679.31
中航证券有限公司	10,320.10
合计	210,747.21
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中航基金管理有限公司	236,990.57
国泰君安证券股份有限公司	1,398.68
中航证券有限公司	15,027.16
合计	253,416.41

①本基金的年销售服务费率为 0.15%。销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，于次月首日起 3 个工作日内按照双方约定的方式从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2017 年 1 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	60,237,720.11	66,450,247.15
报告期间申购/买入总份额	211,848,841.26	9,787,472.96
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	92,000,000.00	16,000,000.00
报告期末持有的基金份额	180,086,561.37	60,237,720.11
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	85.19%	56.62%

根据《中航航空宝货币市场基金招募说明书》的规定，本基金不收取交易基金的费用。

7.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末，除管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2020年1月1日至2020年12月31 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	国泰君安证券股份 有限公司	11,963,504.94	205,013.58	2,360,913.87

包括活期存款，存在托管银行的定期存款，基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司的证券交易结算资金，即结算备付金、交易保证金。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收 基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
3,271,430.95	-	7,647.02	3,279,077.97	-

7.4.12 （2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资。本基金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的是在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险发生的可能损失。从定性分析的角度触发，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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

董事会对公司风险管理负有最终责任，董事会下设合规及风险管理委员会与督察长。合规及风险管理委员会主要负责审核和指导公司的风险管理政策，对公司的整体风险水平、风险控制措施的实施情况进行评价。督察长负责组织指导公司监察稽核工作，监督检查受托资产和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

经营管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，经营管理层下设风险控制委员会。风险控制委员会主要负责审议风险管理制度和流程，处置重大风险事件，促进风险管理文化的形成。

监察稽核部和风险管理部是公司内部控制的职能部门。各职能部门负责从经营管理的各环节上贯彻落实风险管理措施，执行风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告等风险管理程序，并持续完善相应的内部控制制度和流程。

7.4.13.2 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。

基金的银行存款存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。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，不投资短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券(上年度末：无)。

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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	148,813,474.05	79,610,424.09
合计	148,813,474.05	79,610,424.09

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中未评级债券主要为国债、政策性金融债、超短期融资券及同业存单等。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	128,812,488.21	69,610,420.68

合计	128,812,488.21	69,610,420.68
----	----------------	---------------

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中未评级债券主要为国债、政策性金融债、超短期融资券及同业存单等。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中未评级债券主要包含国债和政策性金融债等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 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于开放日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于开放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。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券）来实现。本基金于 12 月 29 日组合平均剩余期限达 124 天，超过《货币市场基金监督管理办法》第九条规定的 120 天指标要求。本基金已经于 12 月 30 日调整完毕，12 月 30 日的组合平均剩余期限 106 天，已符合法规要求（公司前十大持有人比例 16.70%，小于 20%，组合平均剩余期限按法规要求不超过 120 天）。本基金投资组合的平均剩余期限在除 12 月 29 日以外的所有交易日均不超过 120 天，且能够通过出售所持有的债券应对流动性需求。此外本基金还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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金于 12 月 29 日组合平均剩余期限达 124 天，超过《货币市场基金监督管理办法》第九条规定的 120 天指标要求。本基金已经于 12 月 30 日调整完毕，12 月 30 日的组合平均剩余期限 106 天，已符合法规要求（公司前十大持有人比例 16.70%，小于 20%，组合平均剩余期限按法规要求不超过 120 天）。本基金投资组合的平均剩余期限在除 12 月 29 日以外的所有交易日均不得超过 120 天。

报告期末，组合平均剩余期限为 71 天，5 天之内的期限资产占比 38.76%。期限较长品种均为信用评级高、流动性比较好、交易比较活跃的债券品种。能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行存款等流动性受限资产投资占比为 0。此外，本基金还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，债券正回购的资金金额在每个交易日均不超过基金资产净值的 20%。报告期内，本基金组合资产具有较好的流动性。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	11,963,504.94	-	-	-	-	-	11,963,504.94
交易性金融资产	29,956,847.60	39,877,099.37	78,979,527.08	-	-	-	148,813,474.05
买入返售金融资产	49,980,194.97	-	-	-	-	-	49,980,194.97
应收利息	-	-	-	-	-	311,429.80	311,429.80
应收申购款	-	-	-	-	-	612,266.09	612,266.09
资产总计	91,900,547.51	39,877,099.37	78,979,527.08	-	-	923,695.89	211,680,869.85
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,290.67	67,290.67
应付托管费	-	-	-	-	-	16,312.89	16,312.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,586.69	30,586.69
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,478.07	7,478.07
应交税费	-	-	-	-	-	690.06	690.06
应付利润	-	-	-	-	-	14,268.79	14,268.79
其他负债	-	-	-	-	-	149,000.00	149,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	285,627.17	285,627.17
利率敏感度缺口	91,900,547.51	39,877,099.37	78,979,527.08	-	-	638,068.72	211,395,242.68
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,360,913.87	-	-	-	-	-	2,360,913.87
交易性金融资产	10,000,003.41	59,718,144.00	9,892,276.68	-	-	-	79,610,424.09
买入返售金融资产	19,696,269.54	-	-	-	-	-	19,696,269.54
应收利息	-	-	-	-	-	262,996.48	262,996.48
应收申购款	-	-	-	-	-	4,558,051.00	4,558,051.00
资产总计	32,057,186.82	59,718,144.00	9,892,276.68	-	-	4,821,047.48	106,488,654.98
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,982.21	28,982.21
应付托管费	-	-	-	-	-	7,025.99	7,025.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,173.73	13,173.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,346.59	5,346.59
应付利润	-	-	-	-	-	6,621.77	6,621.77
其他负债	-	-	-	-	-	29,000.00	29,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	90,150.29	90,150.29

利率敏感度缺口	32,057,186.82	59,718,144.00	9,892,276.68	-	-4,730,897.19	106,398,504.69
---------	---------------	---------------	--------------	---	---------------	----------------

7.4.13.4.1.2 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（单位：人民币元）	
		本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-100,761.30	-27,891.31
	市场利率下降25个基点	101,087.27	27,985.30

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	149,007,000.00	70.49	79,649,000.00	74.86

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	149,007,000.00	70.49	79,649,000.00	74.86

本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有权益类证券及贵金属投资、权证投资等，因此无重大其他价格风险敞口。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金无其他价格风险敞口。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

7.4.14 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	固定收益投资	148,813,474.05	70.30
	其中:债券	148,813,474.05	70.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	49,980,194.97	23.61
	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	11,963,504.94	5.65
4	其他各项资产	923,695.89	0.44
5	合计	211,680,869.85	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.11	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	124
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2020 年 12 月 29 日	124	-	-

赎回导致平均剩余期限超标，已于 1 个工作日内调整完毕

8.3.2 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	43.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	4.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	9.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	27.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.70	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,002,542.53	4.73
	其中：政策性金融债	10,002,542.53	4.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,998,443.31	4.73
6	中期票据	-	-
7	同业存单	128,812,488.21	60.93
8	其他	-	-
9	合计	148,813,474.05	70.40
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	112003071	20 农业银行 CD071	200,000	19,958,404.29	9.44
2	112089844	20 杭州银行 CD191	200,000	19,814,193.28	9.37
3	112074614	20 徽商银行 CD144	200,000	19,725,302.52	9.33
4	160206	16 国开 06	100,000	10,002,542.53	4.73
5	012003318	20 中电投 SCP024	100,000	9,998,443.31	4.73
6	112010472	20 兴业银行 CD472	100,000	9,971,514.75	4.72
7	112021324	20 渤海银行 CD324	100,000	9,961,030.69	4.71

8	112087455	20 徽商银行 CD079	100,000	9,942,011.40	4.70
9	112016272	20 上海银行 CD272	100,000	9,885,836.39	4.68
10	112009366	20 浦发银行 CD366	100,000	9,875,603.68	4.67

8.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2241%
报告期内偏离度的最低值	-0.0588%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0601%

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

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

16 国开 06 (代码:160206)

2020 年 12 月 25 日,中国银行保险监督管理委员会对国家开发银行审查发现,为违规的政府购买服务项目提供融资;项目资本金管理不到位,棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况;违规变相发放土地储备贷款;设置不合理存款考核要求,以贷转存,虚增存款;贷款风险分类不准确;向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产;违规进行信贷资产拆分转让,隐匿信贷资产质量;向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品;扶贫贷款存贷挂钩;易地扶贫搬迁贷款

“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；未落实同业业务交易对手名单制监管要求；以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；违规收取小微企业贷款承诺费；收取财务顾问费质价不符；利用银团贷款承诺费浮利分费；向检查组提供虚假整改说明材料；未如实提供信贷资产转让台账；案件信息迟报、瞒报；对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。

罚款 4880 万元

本基金投资 16 国开 06 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

20 农业银行 CD071（代码:112003071）

2020 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行审查发现，农业银行收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）。没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行审查发现，向关系人发放信用贷款；批量处置不良资产未公告；批量处置不良资产未向监管部门报告；违规转让正常类贷款；个人住房贷款首付比例违规；流动资金贷款被用于固定资产投资；超过实际需求发放流动资金贷款；贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发；贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；承兑业务贸易背景审查不严；保理业务授权管理不到位；贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人；贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金；信贷资金用于兑付到期理财资产；信贷资金用于承接承销债券；销售非保本理财产品违规出具承诺函；提供与事实不符的报告；理财产品相互交易、相互调节收益；面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资；将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款；开立同业银行结算账户不合规；个别人员未经核准即履行高管人员职责；对小微企业不当收费；未按规定报送案件。

没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元。

2020 年 4 月 22 日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行审查发现，“两会一层”境外机构管理履职不到位；国别风险管理不满足监管要求；信贷资金被挪用作保证金；未将集团成员纳入集团客户统一授信管理。罚款合计 200 万元。

2020 年 4 月 22 日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行审查发现，农业银行监管标准

化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：资金交易信息漏报严重；信贷资产转让业务漏报；贸易融资业务漏报；分户账明细记录应报未报；分户账账户数据应报未报；关键且应报字段漏报或填报错误。罚款合计 230 万元。

2020 年 3 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行审查发现，可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、部分可回溯视频质检结果未反馈给保险公司、可回溯资料不符合监管规定等行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条的规定，根据该法第四十六条，决定对农业银行总行罚款 50 万元。

2020 年 1 月 19 日，农业银行因未依法履行职责，被国家税务总局北京市海淀区税务局处以罚款 50 万元。

本基金投资 20 农业银行 CD071 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

20 徽商银行 CD144（代码:112074614）20 徽商银行 CD079（代码:112087455）

2020 年 09 月 30 日，安徽银保监局对徽商银行审查发现，同业业务专营部门管理不到位；信贷资产非真实转让；同业投资严重不审慎；同业投资风险分类不实，处以 290 万元罚款。

2020 年 08 月 14 日，中央银行合肥中心支行对徽商银行有限公司审核发现，其违反反洗钱法，未依法履行职责，警告并处罚款 49.5 万元。

2020 年 08 月 07 日，中国人民银行合肥中心支行对徽商银行审查发现，备案类账户开立未及时备案；个人银行账户开立未备案；经收预算收入未在规定账户核算，转入“待结算财政款项”以外其他科目或账户核算；违反安全管理规定；未按规定开展客户身份识别，罚款合计 260 万元。

本基金投资 20 徽商银行 CD144, 20 徽商银行 CD079 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

20 杭州银行 CD191（代码:112089844）

2020 年 1 月 16 日，中国银保监会浙江监管局对杭州银行审查发现，虚增存贷款；个人经营性贷款管理不审慎，贷款资金被挪用于购房；向资本金比例不足的房地产项目提供融资；同业投资资金违规投向股权投资领域；理财投资非标资产严重不审慎，罚款 225 万元。

2020 年 1 月 3 日，中国银保监会浙江监管局对杭州银行审查发现，贷后管理不到位，流动资金贷款挪用入房地产企业，罚款 50 万元。

本基金投资 20 杭州银行 CD191 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

20 兴业银行 CD320（代码:112010320）

2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司审核发现，其为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定；未按规定履行客户身份识别义务。给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款

2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司审核发现，同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保，没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。

2020 年 11 月 19 日，兴业银行股份有限公司涉嫌违反法律法规被中国银行间市场交易商协会监管启动自律调查。

2020 年 4 月 27 日，兴业银行股份有限公司因违法自律规则被中国银行间市场交易商协会自律处分。

2020 年 5 月 15 日，中国银行间交易商协会根据相关自律规定，发现兴业银行股份有限公司在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本，对兴业银行予以警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

2020 年 1 月 13 日，国家计算机病毒应急处理中心监测到兴业银行 APP 存在未向用户明示申请的全部隐私权限，涉嫌隐私不合规。存在违规经营的违规行为。

本基金投资 20 兴业银行 CD320 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

20 渤海银行 CD501（代码:112021501）20 渤海银行 CD324（代码:112021324）

2020 年 11 月 06 日，中国银行间市场交易商协会对渤海银行审查发现，内部制度不完善，未依法履行职责，对渤海银行予以诫勉谈话，责令其全面深入整改。

本基金投资 20 渤海银行 CD501,20 渤海银行 CD324 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

20 浦发银行 CD366（代码:112009366）

2020 年 8 月 10 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限

公司审核发现，2013 年至 2018 年，该行存在下列违法违规事实：未按专营部门制规定开展同业业务；同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；延迟支付同业投资资金吸收存款；为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；未按规定进行贷款资金支付管理与控制；个人消费贷款贷后管理未尽职；通过票据转贴现业务调节信贷规模；银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；办理无真实贸易背景的贴现业务；委托贷款资金来源审查未尽职；未按权限和程序办理委托贷款业务；未按权限和程序办理非融资性保函业务。责令改正，并处罚款共计 2100 万元

2020 年 4 月 16 日，中国银保监会消费者权益保护局对浦发银行侵害消费者权益案例通报如下：2018 年 9 月，浦发银行代理销售的私募产品出现延期兑付的问题，引发多起消费者投诉。经查，浦发银行存在以下侵害消费者权益的行为：一是在准入环节未对所代理的产品进行充分分析，尽职调查不到位，与相关监管规定不符；二是在向部分客户销售所代理的产品时，未按照监管要求，在网点专门区域销售代销产品并录音录像，而是采用上门服务模式。三是产品合同的首页出现了明显的浦发银行标识，容易使消费者误认为该产品为浦发银行自主管理理财产品，与相关监管规定不符；四是风险揭示书中未包含产品类型、产品风险评级及适合购买的客户评级、客户权益须知等内容，与相关监管规定不符；五是未按照监管要求，在产品发行后持续跟踪和穿透管理。该行在产品成立至 2018 年 7 月期间，未能按照相关规定督促合作机构进行信息披露。

本基金投资 20 浦发银行 CD366 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

20 上海银行 CD272（代码:112016272）

2020 年 11 月 18 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行股份有限公司审核发现，2014 年至 2018 年，该行绩效考评管理严重违反审慎经营规则。2018 年，该行未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬。责令改正，并处罚款共计 80 万元。

2020 年 8 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行股份有限公司审核发现，2014 年至 2019 年，上海银行存在下列违法违规行为：违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款，以其他贷款科目发放房地产开发贷款；并购贷款管理严重违反审慎经营规则；经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则；个人贷款业务严重违反审慎经营规则；流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则；违规向关系人发放信用贷款；发放贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；贷款分类不准确；违规审批转让不符合不良贷款认定标准的信贷资产；虚增存贷款；违规收费；票据业务严重违反审慎经营规则；同业资金投向管理严重违反审慎经营规则；理财业务严重违反审慎经营规则；委托贷款业务严重违反审慎经营规则；内保外贷业务严重违反审慎经营规则；衍生品交易人员管理严重违反审慎经营规则；监事会履职严重不到位；未经任职资格许

可实际履行高级管理人员职责；关联交易管理严重不审慎；押品估值管理严重违反审慎经营规则；未按规定保存重要信贷档案，导致分类信息不准确、不完整；未按规定报送统计报表，责令改正，没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万元，罚没合计 1652.155092 万元。

本基金投资 20 上海银行 CD272 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

中航航空宝货币基金除 16 国开 06, 20 农业银行 CD071, 20 徽商银行 CD144, 20 徽商银行 CD079, 20 杭州银行 CD191, 20 兴业银行 CD320, 20 渤海银行 CD501, 20 浦发银行 CD366, 20 上海银行 CD272, 投资的前十大证券的发行主体本期没有出现监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责和处罚的情形。

8.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	311,429.80
4	应收申购款	612,266.09
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	923,695.89

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
4,207	50,248.45	201,225,334.95	95.19%	10,169,907.73	4.81%

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	基金类机构	14,004,024.94	6.62%
2	基金类机构	1,741,385.00	0.82%
3	其他机构	1,512,614.31	0.72%
4	其他机构	1,154,710.77	0.55%
5	基金类机构	859,999.69	0.41%
6	基金类机构	817,046.77	0.39%
7	基金类机构	544,780.79	0.26%
8	个人	461,298.92	0.22%
9	个人	400,470.63	0.19%
10	个人	395,640.02	0.19%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	15,968.53	0.01%

9.4 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的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 1 月 25 日）基金份额总额	520,655,938.43
本报告期期初基金份额总额	106,398,504.69
本报告期基金总申购份额	654,531,139.88
减:本报告期基金总赎回份额	549,534,401.89
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	211,395,242.68

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 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

1、2020年7月2日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，刘建先生担任公司总经理，陈四汝先生因个人原因不再担任总经理；张大为先生因个人辞职，不再担任公司副总经理。

2、2020年7月2日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于公司董事及独立董事变更的公告》，选举洪正华先生、王革文先生、刘建先生、陈霆先生、王治鉴先生、苏桂锋先生担任公司董事职务，免去陈四汝先生董事职务；选举邓海清先生、孙宝文先生、钟宏武先生担任公司独立董事职务，刘俊海先生、王军生先生、陈卫平先生、刘善存先生不再担任公司独立董事职务。

3、2020年7月15日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，武国强先生担任公司督察长，武宜达先生因个人辞职不再担任公司督察长。

4、2020年12月9日，经公司2020年第三次股东会会议决议，同意邓海清辞去独立董事职务，选举范立夫担任公司独立董事。

5、2020年12月23日，经公司2020年第四次股东会会议决议，选举杨彦伟、杜鹃担任公司内部董事，免去王革文、陈霆公司董事职务。

6、2020年12月31日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，杨彦伟先生担任公司董事长，洪正华先生担任公司副董事长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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事项。

11.4 基金投资策略的改变

无

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金提供审计服务的会计师事务所由中喜会计师事务所（特殊普通合伙）更换为天职国际会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付给天职国际会计师事务所（特殊普通合

伙) 报酬为 20,000.00 元, 截至 2020 年 12 月 31 日, 该审计机构向本基金提供服务不满 1 年。

11.6 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, 未出现管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国泰君安股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

1: 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2: 交易单元的选择标准和程序

(1) 经营行为规范, 在近一年内无重大违规行为;

(2) 公司财务状况良好;

(3) 有良好的内控制度, 在业内有良好的声誉;

(4) 有较强的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告;

(5) 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议, 并通知基金托管人。

11.7.2 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	
	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
国泰君安股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内本基金不存在偏离度的绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 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	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月3日
2	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年5月12日
3	关于中航基金管理有限公司注册资本及股权变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年6月17日
4	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书（2020年第1号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年6月18日
5	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书摘要（2020年第1号）	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年6月18日
6	6 中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年7月2日
7	6 中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年7月2日
8	中航基金管理有限公司关于公司董事及独立董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理	2020年7月2日

		人网站、中国证监会基金电子披露网站	
9	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书（2020 年第 2 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 6 日
10	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书摘要（2020 年第 2 号）	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 6 日
11	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 15 日
12	中航航空宝货币市场基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 31 日
13	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 7 日
14	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书（2020 年第 3 号）	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 25 日
15	中航航空宝货币市场基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 25 日
16	关于中航基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 31 日
17	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20200101-20201231	60,237,720.11	211,848,841.26	92,000,000.00	180,086,561.37	85.19%
	2	20200519-20200924	0.00	50,442,013.21	50,442,013.21	0.00	0.00%
	3	20200930-20201018 20201021-20201105	0.00	95,865,637.77	95,865,637.77	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金本报告期内存在单一持有人持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，当单一持有人持有份额超 20%时，将面临客户集中度较高的风险，对基金规模的稳定性带来隐患，可能的赎回将可能引发产品的流动性风险。本管理人将加强与客户的沟通，尽量了解申赎意向，审慎确认大额申购与大额赎回，提前做好投资计划，有效防控产品流动性风险，公平对待投资者，保障中小投资者合法权益，本基金管理人拥有完全、独立的投资决策权，不受特定投资者的影响。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2020 年 6 月 17 日，本基金管理人发布《关于中航基金管理有限公司注册资本及股权变更的公告》，公司注册资本由 10,000 万元增加至 30,000 万元，公司的股东及持股比例变更为：中航证券有限公司持有股份 55%、北京首钢基金有限公司持有股份 45%。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准中航航空宝货币市场基金募集的文件
- 12.1.2 《中航航空宝货币市场基金基金合同》
- 12.1.3 《中航航空宝货币市场基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.5 报告期内中航航空宝货币市场基金在指定媒体上披露的各项公告
- 12.1.6 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

中航基金管理有限公司，地址：北京市朝阳区安立路 78、80 号 11 层 1101 内 1105 室

13.3 查阅方式

- 12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.avicfund.cn
- 12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询：400-666-2186

中航基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日