

中航航行宝货币市场基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 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 8 月 28 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 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	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.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 债券回购融资情况.....	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 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.....	39
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
7.8 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.....	39
7.9 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	48
10.9 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50

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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 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	408,567,620.27 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 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 在考虑安全性因素的前提下,本基金管理人将积极发掘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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>5、回购策略</p> <p>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。</p> <p>6、现金流管理策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 19 楼
邮政编码		100101	200041
法定代表人		杨彦伟	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金中期报告备置地点	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
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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	2,865,305.22
本期利润	2,865,305.22
本期净值收益率	0.9948%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末基金资产净值	408,567,620.27
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
累计净值收益率	12.3950%

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。

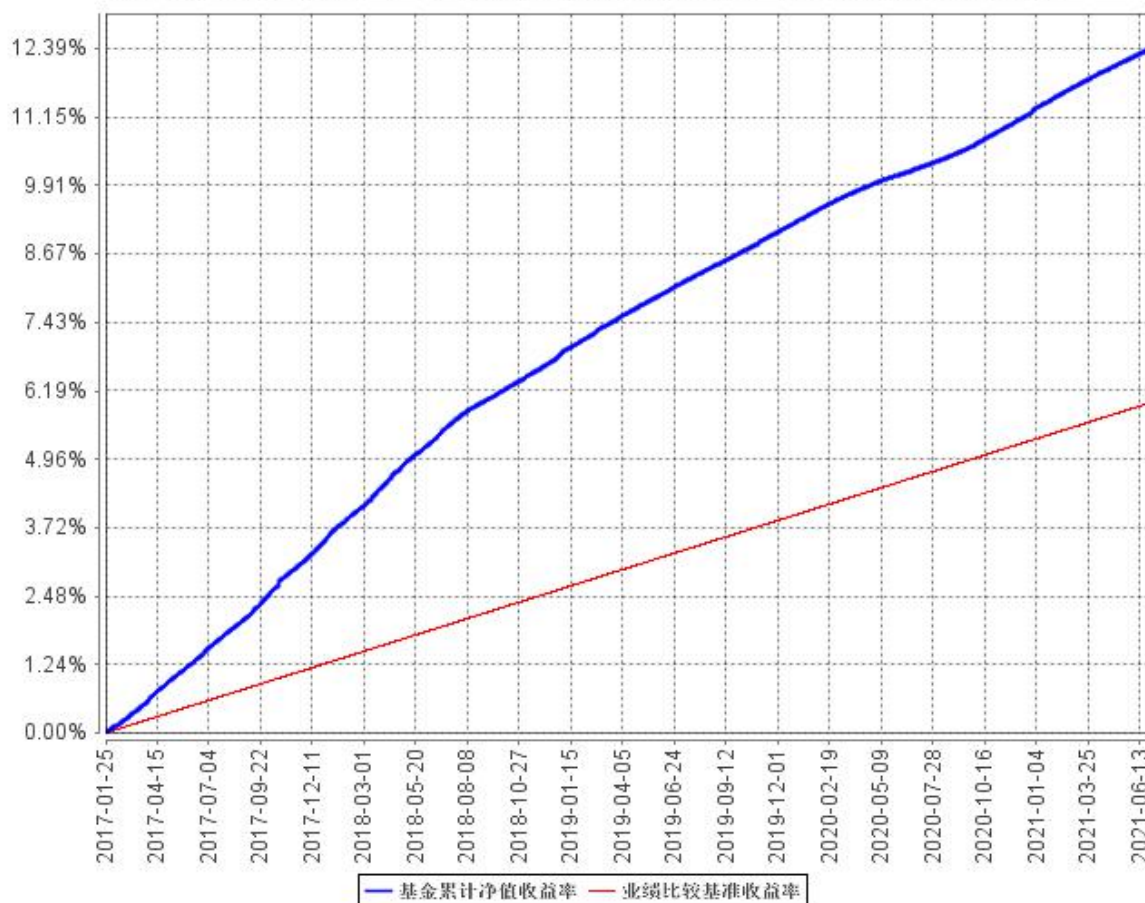
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.1526%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.0416%	0.0002%
过去三个月	0.4695%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.1329%	0.0006%
过去六个月	0.9948%	0.0007%	0.6695%	0.0000%	0.3253%	0.0007%
过去一年	1.9877%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.6377%	0.0015%
过去三年	6.5758%	0.0020%	4.0537%	0.0000%	2.5221%	0.0020%
自基金合同生效起至今	12.3950%	0.0036%	5.9844%	0.0000%	6.4106%	0.0036%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

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



3.3 其他指标

无

§ 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 2021 年 6 月 30 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，一只基础设施证券投资基金——中航首钢生物质封闭式基础设施证券投资基金，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		
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。
杜晓安	基金经理	2017 年 1 月 25 日	2021 年 3 月 23 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 2021 年 3 月，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合规守信情况的说明

报告期内，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。本报告期内，本基金运作合法合规，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 公平交易制度的执行情况

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。

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。

4.3.2 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 348 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

2021 年上半年，国内经济延续修复趋势，总体呈现稳中向好的格局，供需缺口收窄，生产端修复强于需求端。生产保持较强韧性，工业修复显著强于服务业；需求延续修复态势，但结构仍不均衡。投资总体继续修复，但结构分化仍较为明显，地产保持较强韧性，基建投资扩张动力不足，制造业投资修复逐步加快；消费虽然呈现逐步改善的迹象，但修复的速度依然偏慢；出口虽然出现边际走弱的迹象，但依然保持较为强劲的走势。PPI 快速走高，但 CPI 仍在相对低位，通胀未成为货币政策的制约因素。央行实施稳健的货币政策，市场流动性总体处于偏宽松状态，仅

在 1 月下半月为传递对资产价格泡沫的态度，央行降低流动性投放力度，市场流动性出现了阶段性的剧烈波动，随后又趋于宽松直至半年末。2021 年上半年，债券市场总体呈现先抑后扬的走势，一季度初受市场流动性影响债券收益率出现了阶段性的上行，随后在市场流动性重新趋于宽松带动下，债券收益率开始下行，期间虽然通胀、美联储收紧预期等因素带来了扰动，但债券市场依然保持较强的走势。由于信用风险事件依然高发，市场风险偏好整体偏低。上半年，本基金继续坚持把风险防范放在第一位，以高评级有托管资格银行的同业存单为主要配置标的，并积极参与逆回购交易，尽可能增厚本基金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 0.9948%，业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年下半年，虽然国内经济仍将维持修复格局，但修复的动力将逐步趋弱，且结构不均衡的局面仍将延续。生产端有望继续保持韧性，出口仍将给工业生产带来支撑。海外疫情仍在反复，虽然出口增速将边际减弱，但外需总体仍将保持较高的景气度；地产投资面临边际走弱压力，制造业投资有望改善，基建投资改善的动力不足，消费改善速度依然偏慢，内需继续显著修复的动力不足，需求端难现大幅改善。PPI 将从高位回落，CPI 仍将相对温和。央行仍将实施稳健的货币政策，市场流动性总体仍将维持平衡略松的状态。下半年，国内经济运行总体相对平稳，但经济结构性问题依然存在，央行货币政策不存在大幅收紧的基础，在此背景下，预计债券市场可能呈现震荡略偏强的走势。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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验。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。

4.7 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 2,865,305.22 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

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

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，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	13,655,213.10	11,963,504.94
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	318,081,379.16	148,813,474.05
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		318,081,379.16	148,813,474.05
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	76,616,794.92	49,980,194.97
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	446,414.60	311,429.80
应收股利		-	-
应收申购款		65,300.00	612,266.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		408,865,101.78	211,680,869.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		105,154.73	67,290.67
应付托管费		25,492.03	16,312.89
应付销售服务费		47,797.61	30,586.69
应付交易费用	6.4.7.7	15,893.28	7,478.07
应交税费		-	690.06

应付利息		-	-
应付利润		23,726.69	14,268.79
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,417.17	149,000.00
负债合计		297,481.51	285,627.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	408,567,620.27	211,395,242.68
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		408,567,620.27	211,395,242.68
负债和所有者权益总计		408,865,101.78	211,680,869.85

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 408,567,620.27 份。

6.2 利润表

会计主体：中航航空宝货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		3,773,829.34	1,313,548.08
1.利息收入		3,770,830.36	1,313,548.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48,480.08	155,395.15
债券利息收入		2,858,814.97	951,813.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		863,535.31	206,339.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,998.98	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,998.98	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		908,524.12	394,074.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	479,492.86	180,237.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	116,240.68	43,693.97

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	217,951.40	81,926.10
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		5,462.33	-
其中：卖出回购金融资产支出		5,462.33	-
6. 税金及附加		359.68	-
7. 其他费用	6.4.7.20	89,017.17	88,216.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,865,305.22	919,473.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,865,305.22	919,473.53

6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	211,395,242.68	-	211,395,242.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,865,305.22	2,865,305.22
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）	197,172,377.59	-	197,172,377.59
其中：1.基金申购款	369,660,130.55	-	369,660,130.55
2.基金赎回款	-172,487,752.96	-	-172,487,752.96
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）	-	-2,865,305.22	-2,865,305.22
五、期末所有者权益（基金净值）	408,567,620.27	-	408,567,620.27
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	-	919,473.53	919,473.53
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）	47,206,960.53	-	47,206,960.53
其中：1.基金申购款	153,932,893.80	-	153,932,893.80
2.基金赎回款	-106,725,933.27	-	-106,725,933.27
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）	-	-919,473.53	-919,473.53
五、期末所有者权益（基金净值）	153,605,465.22	-	153,605,465.22

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：

 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

6.4 报表附注

6.4.1 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《中航航空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《中航航空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。

6.4.2 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 3 号—半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。

6.4.3 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期本基金所采用的会计政策、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

本报告期本基金无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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【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》、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. 基金买卖债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税；

4. 存款利息收入不征收增值税；

5. 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税；

6. 对基金取得的企业债券利息收入，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	3,655,213.10
定期存款	10,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	10,000,000.00
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	13,655,213.10

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 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	318,081,379.16	318,125,000.00	43,620.84	0.0107%
	合计	318,081,379.16	318,125,000.00	43,620.84	0.0107%
资产支持证券	-	-	-	0.0000%	

合计	318,081,379.16	318,125,000.00	43,620.84	0.0107%
----	----------------	----------------	-----------	---------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	76,616,794.92	-
合计	76,616,794.92	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,965.49
应收定期存款利息	1,611.12
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	414,273.97
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	28,564.02
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	446,414.60

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	15,893.28
合计	15,893.28

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30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	79,417.17
合计	79,417.17

预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和银行间账户维护费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	211,395,242.68	211,395,242.68
本期申购	369,660,130.55	369,660,130.55
本期赎回(以“-”号填列)	-172,487,752.96	-172,487,752.96
- 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	408,567,620.27	408,567,620.27

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。

6.4.7.10 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	2,865,305.22	-	2,865,305.22

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	-2,865,305.22	-	-2,865,305.22
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	46,868.96
定期存款利息收入	1,611.12
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	48,480.08

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期本基金无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30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	2,998.98
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	2,998.98

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	400,596,380.11
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	399,906,482.50
减：应收利息总额	686,898.63
买卖债券差价收入	2,998.98

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本报告期本基金无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本报告期本基金无公允价值收益。

6.4.7.18 其他收入

本报告期本基金无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本报告期本基金无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	10,909.80
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	89,017.17

6.4.7.21 分部报告

无

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**

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 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。

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**

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化的情况。

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
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

6.4.10 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。

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**

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	479,492.86	180,237.66
其中：支付销售机构的客户维护费	29,817.95	19,043.45

本基金的管理费按前一日资产净值 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

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。

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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	116,240.68	43,693.97

本基金的托管费按前一日资产净值 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

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、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	174,406.60
国泰君安证券股份有限公司	307.43
中航证券有限公司	4,592.25
合计	179,306.28
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	62,719.68
国泰君安证券股份有限公司	377.22
中航证券有限公司	5,658.52
合计	68,755.42

本基金的年销售服务费率为 0.15 %。销售服务费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

基金销售服务费每日计提，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，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

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

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

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	180,086,561.37	60,237,720.11
报告期间申购/买入总份额	101,894,312.98	514,443.81
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	60,000,000.00	2,000,000.00
报告期末持有的基金份额	221,980,874.35	58,752,163.92
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	54.33%	38.25%

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。

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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	3,655,213.10	46,868.96	12,067,429.01	155,395.15

包括活期存款、结算备付金、交易保证金。

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。

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

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
2,855,847.32	-	9,457.90	2,865,305.22	-

6.4.12 期末（2021 年 6 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

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。

6.4.12.2 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。

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

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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业务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。

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。

6.4.13.2.1 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,983,894.99	148,813,474.10
合计	29,983,894.99	148,813,474.10

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剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、超短期融资券及同业存单等。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	288,097,484.17	128,812,488.20
合计	288,097,484.17	128,812,488.20

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。

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（企业债和短期融资券）来实现。本报告期内，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且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。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，债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 20%。报告期末，组合平均剩余期限为 67 天，现金、国债、央票、政策性金融债及五个交易日到期的其他金融工具占比 26.99%。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。报告期内，本基金组合资产具有较好的流动性。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月 30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	13,655,213.10	-	-	-	-	-	13,655,213.10
交易性金融资产	79,885,341.03	89,725,149.02	148,470,889.11	-	-	-	318,081,379.16
买入返售金融资产	76,616,794.92	-	-	-	-	-	76,616,794.92
应收利息	-	-	-	-	-	446,414.60	446,414.60
应收申购款	-	-	-	-	-	65,300.00	65,300.00
资产总计	170,157,349.05	89,725,149.02	148,470,889.11	-	-	511,714.60	408,865,101.78
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	105,154.73	105,154.73
应付托管费	-	-	-	-	-	25,492.03	25,492.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	47,797.61	47,797.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,893.28	15,893.28
应付利润	-	-	-	-	-	23,726.69	23,726.69
其他负债	-	-	-	-	-	79,417.17	79,417.17
负债总计	-	-	-	-	-	297,481.51	297,481.51
利率敏感度缺口	170,157,349.05	89,725,149.02	148,470,889.11	-	-	214,233.09	408,567,620.27
上年度末 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

6.4.13.4.1.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-184,794.21	-100,761.30
市场利率下降 25 个基点	185,380.33	101,087.27	

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。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	318,125,000.00	77.86	149,007,000.00	70.49
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	318,125,000.00	77.86	149,007,000.00	70.49

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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金无其他价格风险敞口。

6.4.13.4.4 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。

6.4.14 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。

§ 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	固定收益投资	318,081,379.16	77.80
	其中: 债券	318,081,379.16	77.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	76,616,794.92	18.74
	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	13,655,213.10	3.34
4	其他各项资产	511,714.60	0.13
5	合计	408,865,101.78	100.00

7.2 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	0.16	
	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

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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
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

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 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	41.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	19.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	2.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	2.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天 (含)	33.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.95	-

7.4 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。

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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	10,000,303.18	2.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,983,591.81	4.89
	其中：政策性金融债	19,983,591.81	4.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	288,097,484.17	70.51
8	其他	-	-
9	合计	318,081,379.16	77.85
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	112110063	21 兴业银行 CD063	500,000	49,562,317.73	12.13
2	112009466	20 浦发银行 CD466	300,000	29,943,663.53	7.33
3	112009297	20 浦发银行 CD297	200,000	19,954,879.77	4.88
4	112015357	20 民生银行 CD357	200,000	19,928,470.26	4.88
5	112106033	21 交通银行 CD033	200,000	19,805,810.19	4.85
6	112180152	21 徽商银行 CD046	200,000	19,799,013.73	4.85
7	200010	20 附息国债 10	100,000	10,000,303.18	2.45
8	200406	20 农发 06	100,000	10,000,213.97	2.45
9	2103664	21 进出 664	100,000	9,983,377.84	2.44
10	112014114	20 江苏银行 CD114	100,000	9,981,725.97	2.44

7.7 “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	0.1047%
报告期内偏离度的最低值	-0.0704%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0337%

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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

7.9.2 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

21 兴业银行 CD063（代码：112110063）

2021 年 1 月 15 日，中国银行间交易商协会根据银行间债券市场相关自律规定，对兴业银行为永煤控股提供中介服务过程中，未对永煤控股独立性开展进一步核查并在尽职调查报告中体现，未能充分保证尽职调查质量；未对永煤控股受限货币资金异常情况保持足够的职业怀疑，未开展进一步核查；永煤控股 DFI 项目尽职调查工作底稿不完整，尽职调查工作开展不规范，予以通报批评，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 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 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的规定；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的规定；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，中国银行保险监督管理委员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。

20 浦发银行 CD466（代码：112009466）、20 浦发银行 CD297（代码：112009297）

2021 年 4 月 23 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未按规定开展代销业务，责令改正，并处罚款共计 760 万元。

2020 年 11 月 26 日，国家外汇管理局上海市分局对上海浦东发展银行违反公正、公平、诚信原则，违规开展外汇市场交易；违反银行交易记录管理规定，罚款 140 万元。

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。

20 民生银行 CD357（代码：112015357）

2020 年 11 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对民生银行违反规定办理售汇业务等，没收违法所得 1910822.20 元人民币，并处 80 万元人民币罚款，给予警告。

2020 年 7 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会对民生银行违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资、为“四证”不全的房地产项目提供融资、违规为土地储备中心提供融资、违规为地方政府提供融资，接受地方政府担保或承诺、多名股东在已派出董事的情况下，以推荐代替提名方式推举独立董事及监事、多名股东在股权质押超比例的情况下违规在股东大会上行使表决权，派出董事在董事会上的表决权也未受限、股东持股份额发生重大变化未向监管部门报告、多名拟任高管人员及董事未经核准即履职、关联交易不合规、理财产品风险信息披露不合规、年报信息披露不真实、贷款资金被挪用，虚增贷款、以贷转存，虚增存款、贸易背景审查不尽职、向关系人发放信用贷款、违规转让正常类信贷资产、违规转让不良资产、同业投资他行非保本理财产品审查不到位，接受对方机构违规担保，少计风险加权资产、同业投资未穿透底层资产计提资本拨备，少计风险加权资产、同业存放业务期限超过一年、违规开展票据转贴现交易、个别理财产品管理费长期未入账、理财业务风险隔离不充分、违规向非高净值客户销售投向股权类资产的理财产品、非标准化资产纳入标准化资产统计，实际非标债权资产比例超监管要求、违规出具补充协议及与事实不符的投资说明、以代销名义变相向本行授信客户融资，并承担兜底风险、向不符合条件的借款人办理收益权转让再融资业务、代理福费廷业务违规承担风险，会计处理不规范、迟报瞒报多起案件（风险）信息等违法违规行，没收违法所得 296.47 万元，

罚款 10,486.47 万元，罚没合计 10,782.94 万元。

21 徽商银行 CD046（代码：112180152）

2020 年 11 月 20 日，安徽银保监局对徽商银行同业业务投资不审慎、理财业务严重违反审慎经营规则、未落实统一授信管理要求，罚款 175 万元。

2020 年 9 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 8 月 7 日，中国人民银行合肥中心支行对徽商银行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，警告，并处罚款 49.5 万元。

20 江苏银行 CD114（代码：112014114）

2020 年 12 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局对江苏银行股份有限公司个人贷款资金用途管控不严、发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款、理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理、个人理财资金对接项目资本金、理财业务未与自营业务相分离、理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求，罚款人民币 240 万元。

本基金投资 21 兴业银行 CD063、20 浦发银行 CD466、20 浦发银行 CD297、20 民生银行 CD357、21 徽商银行 CD046、20 江苏银行 CD114 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金除 21 兴业银行 CD063、20 浦发银行 CD466、20 浦发银行 CD297、20 民生银行 CD357、21 徽商银行 CD046、20 江苏银行 CD114 外，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。

7.9.3 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	446,414.60
4	应收申购款	65,300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	511,714.60

§ 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

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
5,368	76,111.70	399,820,472.88	97.86%	8,747,147.39	2.14%

8.2 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	72,344,757.49	17.71%
2	券商类机构	50,190,440.01	12.28%
3	银行类机构	50,190,440.01	12.28%
4	基金类机构	1,658,287.75	0.41%
5	其他机构	1,527,674.97	0.37%
6	基金类机构	868,562.48	0.21%
7	基金类机构	550,204.97	0.13%
8	个人	465,891.90	0.11%
9	个人	350,466.13	0.09%
10	个人	302,978.44	0.07%

8.3 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	12,304.61	0.00%

8.4 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、基金投资和研发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
-----------------	---

§ 9 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	211,395,242.68
本报告期基金总申购份额	369,660,130.55
减：本报告期基金总赎回份额	172,487,752.96
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	408,567,620.27

基金总申购份额包含基金红利再投份额、基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

1、2021 年 3 月 30 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变更的公告》，公告自 2020 年 12 月 9 日至 2021 年 3 月 29 日期间，董事变更超过百分之五十的情况如下：

(1) 2020 年 12 月 9 日，经公司 2020 年第三次股东会决议通过，选举范立夫先生担任公司独立董事职务，同意邓海清先生辞去独立董事职务。

(2) 2020 年 12 月 23 日，经公司 2020 年第四次股东会决议通过，选举杨彦伟先生、杜鹃女士担任公司董事职务，免去王革文先生、陈霆先生公司董事职务。

(3) 2021 年 3 月 29 日，经公司第五次股东会决议通过，选举许华杰先生、叶芊先生担任公司董事职务，免去王治鉴先生、苏桂锋先生公司董事职务。

2、2021 年 3 月 25 日，本基金管理人发布《中航航空宝货币市场基金基金经理变更公告》，杜晓安女士因个人原因于 2021 年 3 月 23 日起，不再担任中航航空宝货币市场基金基金经理，公司已按规定在中国证券投资基金业协会办理变更、注销手续。

3、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

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。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经本公司董事会及总经理办公会审议通过，自 2021 年 2 月 9 日起由中喜会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为天职国际会计师事务所（特殊普通合伙），详情请见本基金管理人于 2021 年 2 月 9 日披露的《中航基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告》。

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

1、本基金管理人报告期内收到北京证监局有关警示函的行政监管措施，对存在的问题，公司已采取相应的改进措施。

2、本报告期内，未出现托管人及其高级管理人员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	

国泰君安股份有限公司	2	-	-	-	-	-
------------	---	---	---	---	---	---

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

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	
	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	-	-	-	-	-	-

10.8 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绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 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	中航基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告	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	2021 年 2 月 9 日
2	中航航空宝货币市场基金基金经理变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网	2021 年 3 月 25 日

		站	
3	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书(2021年第1号)	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021年3月25日
4	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	2021年3月25日
5	中航基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	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	2021年4月16日

§ 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

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	20210101-20210630	180,086,561.37	101,894,312.98	60,000,000.00	221,980,874.35	54.33%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：

- (1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；
- (2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；
- (3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；
- (4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；
- (5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

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

- 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规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

12.2 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

12.3 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 8 月 28 日