

中航航行宝货币市场基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中航航空宝
交易代码	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
报告期末基金份额总额	370,642,566.35 份
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</p>

	<p>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</p> <p>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</p> <p>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。</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。</p> <p>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。
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

§ 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（2021年7月1日—2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,809,554.74
2. 本期利润	1,809,554.74
3. 期末基金资产净值	370,642,566.35

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。

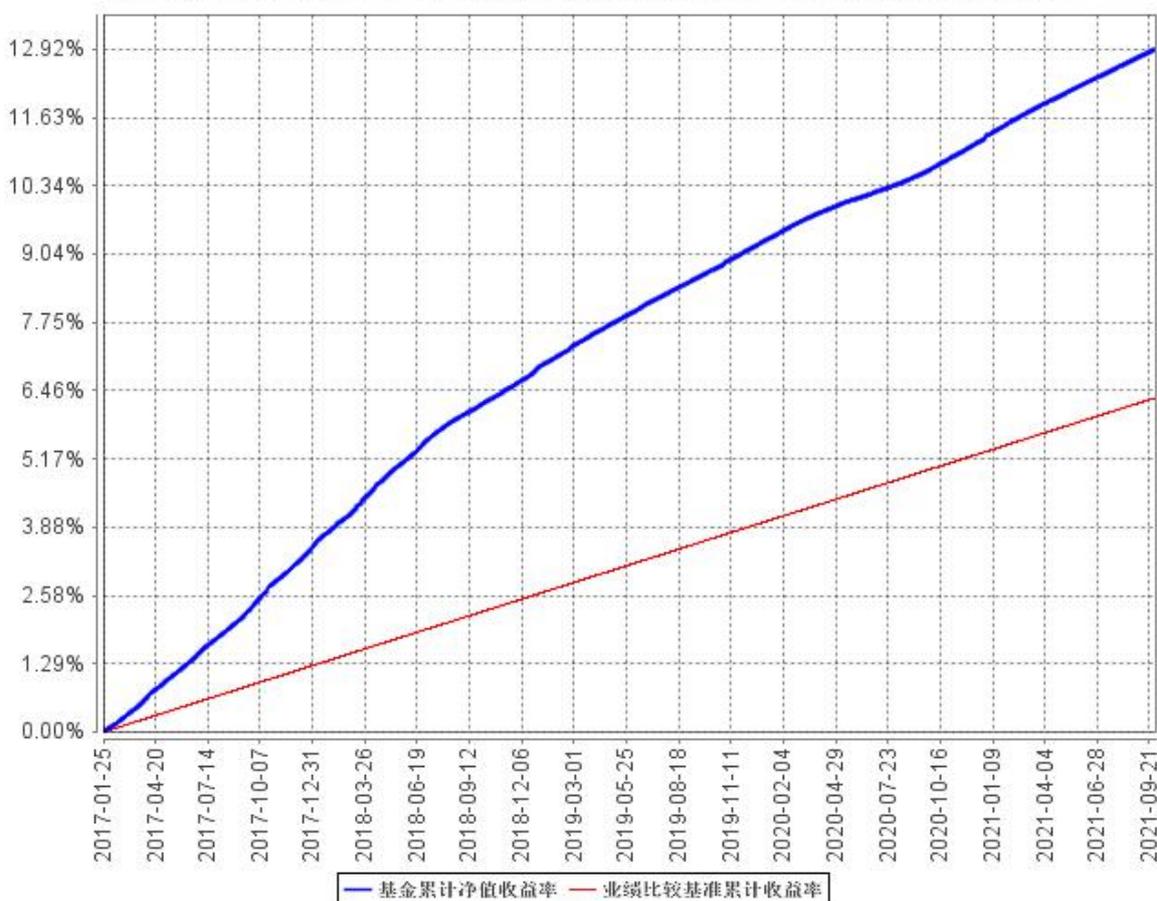
3.2 基金净值表现

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	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	0.4682%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.1279%	0.0002%
过去六个月	0.9398%	0.0004%	0.6732%	0.0000%	0.2666%	0.0004%
过去一年	2.0614%	0.0014%	1.3500%	0.0000%	0.7114%	0.0014%
过去三年	6.3432%	0.0018%	4.0537%	0.0000%	2.2895%	0.0018%
过去五年	12.9212%	0.0036%	6.3247%	0.0000%	6.5965%	0.0036%
自基金合同 生效起至今	12.9212%	0.0036%	6.3247%	0.0000%	6.5965%	0.0036%

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

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



§ 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		
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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《中航航行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 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，基金管理人严格执行《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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年三季度，在疫情局部反复、水灾、能耗双控等因素影响下，国内主要经济指标出现走弱迹象，经济修复动能有所减弱。工业生产增速逐步下行，且 PMI 生产指数显著回落，显示生产端仍在承压过程中。投资修复动力不强，地产调控政策效果显现使地产投资承压，基建修复动力依然不足，制造业投资增速表现较好；疫情局部反复，对短期消费产生明显冲击，而就业、收入增长等因素制约消费的修复；出口依然保持较高的韧性，但出口动能面临回落的压力。PPI 继续走高，并出现向 CPI 传导迹象，通胀预期开始上升。央行继续实施稳健的货币政策，保持连续性、

稳定性、可持续性，虽然央行进行了一次全面降准，但市场流动性未见显著宽松，且市场资金价格中枢有所上移。三季度，债券市场整体呈现先上涨后震荡的格局，7月在降准推动下，债券市场收益率快速下行，随后由于债市缺少进一步上涨的催化因素而陷入震荡走势。三季度，本基金继续把控制风险放在第一位，以高评级有托管资格银行的同业存单为主要配置标的，并利用资金价格上行的机会积极参与逆回购交易，尽可能增厚本基金收益。

4.5 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 0.4682%，业绩比较基准收益率为 0.3403%。

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	239,142,591.28	64.47
	其中：债券	239,142,591.28	64.47
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	130,000,675.00	35.04
	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	1,139,791.76	0.31
4	其他资产	674,393.98	0.18
5	合计	370,957,452.02	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	0.14	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	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

本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

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	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

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未存在超过 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	38.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	37.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	8.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	10.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	5.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.90	-

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未存在超过 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	30,022,685.72	8.10
	其中：政策性金融债	30,022,685.72	8.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	209,119,905.56	56.42
8	其他	-	-
9	合计	239,142,591.28	64.52
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序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	112110063	21 兴业银行 CD063	500,000	49,881,515.89	13.46
2	210201	21 国开 01	200,000	20,016,677.60	5.40
3	112121289	21 渤海银行 CD289	200,000	19,954,163.42	5.38
4	112106033	21 交通银行 CD033	200,000	19,940,954.40	5.38
5	112180152	21 徽商银行 CD046	200,000	19,931,813.32	5.38
6	200314	20 进出 14	100,000	10,006,008.12	2.70
7	112012122	20 北京银行 CD122	100,000	9,988,538.41	2.69
8	112106020	21 交通银行 CD020	100,000	9,976,344.07	2.69
9	112014196	20 江苏银行 CD196	100,000	9,974,444.49	2.69
10	112014222	20 江苏银行 CD222	100,000	9,959,763.38	2.69

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	0.0418%
报告期内偏离度的最低值	-0.0133%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0238%
------------------------	---------

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

本基金本报告期内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序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。

5.9.2 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 8 月 13 日，中国人民银行对兴业银行违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，罚款 5 万元。

2021 年 7 月 21 日，国家外汇管理局福建省分局对兴业银行违规办理内保外贷业务；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料；违反外汇市场交易管理规定；未按规定保存交易通讯记录；违规办理银行卡业务，责令改正、给予警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元人民币、责令对相关责任人进行处分。

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。

21 国开 01（代码：210201）

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。

2020 年 10 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对国家开发银行违反银行交易记录管理规定，处 60 万元人民币罚款；国家外汇管理局北京外汇管理部对国家开发银行违规开展外汇交易，处 60 万元人民币罚款。

21 渤海银行 CD289（代码：112121289）

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对渤海银行地方政府购买服务项目贷款不合规、违规向资本金不足的房地产项目发放贷款、违规向四证不全的房地产项目发放贷款、违规通过同业投资或理财募集资金为四证不全的房地产项目提供融资、违规发放土地储备贷款、重大关联交易未经董事会批准、一般关联交易未按程序审批、内部审计严重不足、瞒报案件（风险信息）、发放流动资金贷款未测算营运资金需求、对个别客户环保政策执行情况调查不尽职、向房地产开发企业发放流动资金贷款、房地产开发贷款授信金额超过项目备案总投资、未落实授信审批条件发放贷款、未按规定执行受托支付、未有效监控贷款使用情况以致贷款被挪用、贷款风险分类不审慎、为代为推介的信托产品到期兑付提供流动性支持、未在官网公示代为推介的信托产品相关信息、银行承兑汇票保证金管理不规范、未严格审核银行承兑汇票贸易背景真实性、部分分行出具与事实不符的理财业务投资情况报告、部分转贴现票据风险加权资产计提不准确、自营业务与代客业务未有效分离、理财产品之间风险未完全隔离、非标准化债权资产占比超监管指标、理财信息登记不准确、理财资金为客户入股其他商业银行提供融资、理财产品信息披露不到位、风险揭示书存在问题、理财资金用于开立本行定期存单、投向权益类资产及集合资金信托计划的理财产品面向一般个人客户销售、单一信贷资产类理财产品期限与标的资产期限不一致、

组合信贷类理财产品高流动性资产低于监管要求，罚款 9720 万元。

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。

21 交通银行 CD033（代码：112106033）、21 交通银行 CD020（代码：112106020）

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行对交通银行违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，罚款 62 万元。

2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行理财业务和同业业务制度不健全；理财业务数据与事实不符；部分理财业务发展与监管导向不符；理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资；理财资金违规投向土地储备项目；理财产品相互交易调节收益；面向机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券；公募理财产品投资单只证券超限额；理财资金违规投向交易所上市交易的股票；理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位；私募理财产品销售文件未约定冷静期；开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求；理财产品信息登记不及时；理财产品信息披露不合规；同业业务交易对手名单调整不及时；将同业存款纳入一般性存款核算；同业账户管理不规范；违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足；结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为；未严格审查委托贷款资金来源；违规向委托贷款借款人收取手续费；利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表；监管检查发现问题屡查屡犯，罚款 4100 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。

20 进出 14（代码：200314）

2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对中国进出口银行违规投资企业股权；个别高管人员未经核准实际履职；监管数据漏报错报；违规向地方政府购买服务提供融资；违规变相发放土地储备贷款；向用地未获国务院批准的项目发放贷款；违规开展租金保理业务变相支持地方政府举债；租金保理业务基础交易不真实；向租赁公司发放用途不合规的流动资金贷款；违规向个别医疗机构新增融资；个别并购贷款金额占比超出监管上限；借并购贷款之名违规发放股权收购贷款；违规向未取得“四证”的固定资产项目发放贷款；违规发放流动资金贷款用于固定

资产投资；授信额度核定不审慎；向无实际用款需求的企业发放贷款导致损失；突破产能过剩行业限额要求授信；项目贷款未按规定设定抵质押担保；贷款风险分类不审慎；信贷资产买断业务贷前调查不尽职；向借款人转嫁评估费用；同业业务交易对手名单制管理落实不到位；贸易背景审查不审慎；对以往监管通报问题整改不到位，罚没 7345.6 万元。

20 北京银行 CD122（代码：112012122）

2021 年 9 月 26 日，北京银保监局对北京银行服务收费管理不力，违规收费；理财和同业投资业务严重违反审慎经营规则；贷款管理不到位导致贷款资金被挪用，责令改正，并给予合计 820 万元罚款的行政处罚。

2021 年 2 月 5 日，中国人民银行营业管理部对北京银行未能确保交易信息的真实性、完整性、可追溯性以及支付全流程中的一致性；未按规定开展条码支付业务；违规开展银行卡收单业务；开立、撤销银行结算账户不规范；未按规定管理支付机构客户备付金，给予警告，没收违法所得 50.317056 万元，并处罚款 451 万元，罚没合计 501.317056 万元。

2020 年 12 月 30 日，北京银保监局对北京银行对外销售虚假金融产品；出具与事实不符的单位定期存款开户证实书；关键业务环节管理失控；同城清算业务凭证要件信息不真实；印章管理混乱；重要岗位员工轮岗管理失效；岗位制衡与授权管理存在缺陷；员工行为管理失察；案件风险排查不力；内审报告存在重大遗漏；信贷业务管理不审慎，责令改正，并给予合计 3940 万元罚款的行政处罚。

2020 年 12 月 23 日，北京银保监局对北京银行下辖西单支行违规出具与事实不符的询证函回函；北京银行下辖西单支行违规出具与事实不符的存款证明；北京银行下辖西单支行内部控制存在缺陷；北京银行现金管理业务内部控制存在缺陷，责令改正，并给予合计 350 万元罚款的行政处罚。

20 江苏银行 CD196（代码：112014196）、20 江苏银行 CD222（代码：112014222）

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、21 国开 01、21 渤海银行 CD289、21 交通银行 CD033、21 交

通银行 CD020、21 徽商银行 CD046、20 进出 14、20 北京银行 CD122、20 江苏银行 CD196、20 江苏银行 CD222 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

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	622,853.98
4	应收申购款	51,540.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	674,393.98

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	408,567,620.27
报告期期间基金总申购份额	23,937,802.71
报告期期间基金总赎回份额	61,862,856.63
报告期期末基金份额总额	370,642,566.35

§ 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	赎回	2021年7月6日	3,000,000.00	-3,000,000.00	-
2	红利再投	-	1,025,658.61	-	-
合计			4,026,658.61	3,000,000.00	

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。

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
----	----------------	------------

者类别	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	20210701-20210930	221,980,874.35	1,025,658.61	3,000,000.00	220,006,532.96	59.36%
	2	20210827-20210930	72,344,757.49	15,339,408.73	-	87,684,166.22	23.66%
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>							

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 中国证监会批准中航航行宝货币市场基金募集的文件
- 9.1.2 《中航航行宝货币市场基金基金合同》
- 9.1.3 《中航航行宝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
- 9.1.5 报告期内中航航行宝货币市场基金在规定媒体上披露的各项公告
- 9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 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

9.3 查阅方式

9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.avicfund.cn

9.3.3 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 10 月 27 日