中航证券鑫航季季添金2号集合资产管理计划

2021年年度资产管理报告

计划管理人：中航证券有限公司

计划托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告期间：2021年1月1日－2021年12月31日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人中航证券有限公司依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称 “《管理办法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“《管理规定》”）及其他有关规定制作。

2020 年 6 月 9 日中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划（以下简称：本集合计划）成立，管理人于 2020 年 6 月 12 日向中国证券投资基金业协会提交了中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划的发起设立情况报告等材料。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合资产管理计划托管人国泰君安证券股份有限公司于 2022 年 4 月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。管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2021 年 1 月 1 日—2021 年 12 月 31 日

一、集合计划简介

（一）基本资料

集合计划名称：中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划

集合计划类型：固定收益类集合资产管理计划

集合计划成立日：2020 年 6 月 9 日

集合计划投资目标：通过对各类金融工具的选择，以及对市场时机的判断，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

集合计划投资理念：通过分析宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，在谨慎投资的前提下，以债券及其他标准化资产为主要投资标的，力争获取高超过业绩基准的投资收益。

集合计划运作方式：通过筹集委托人资金交由托管人托管，由集合资产

管理计划管理人统一管理和运用，投资于法律法规或中国证监会允许本集合计划投资范围及其他金融工具或品种。

集合计划风险收益特征：本计划属固定收益类集合资产管理计划，不分级，风险等级为R3-中风险，适合C3-稳健型及以上合格投资者。

（二）集合计划管理人：中航证券有限公司

（三）集合计划托管人：国泰君安证券股份有限公司

（四）注册登记机构：中航证券有限公司

（五）会计师事务所和经办注册会计师：天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）

二、集合计划管理人履职报告

（一）投资经理工作报告

1、投资回顾

2021年全球疫情不断演变，借助于强有力的财政和货币政策，全球经济曲折复苏。不过随着疫情不断反复和演化，全球经济面对的不确定性风险仍较大。整体看，2021年全球经济呈继续复苏态势，但复苏路径不均衡，一季度减缓，二季度加快，三季度再放缓，四季度仍维持低增速。疫情反复以及长期的宽松政策下美国通胀持续上行，就业持续恢复，但疫情对就业市场带来的长期影响难以快速好转。美联储政策长期维持鸽派，但11月末开始加速转鹰。除美联储以外，世界其他发达经济体货币政策转向速度也有加快迹象，发展中经济体面临的通胀压力更为严重，提早进入紧缩周期。

2021年中国经济延续复苏，但三季度开始受消费疲软和房地产投资下滑拖累，中国经济增速持续下行，稳增长压力逐步增大。财政、信贷、监管等方向上的稳增长措施加强，12月经济数据显示经济正在筑底。2021年上半年国内政策以控风险为主，下半年随经济下行压力增大稳增长意图逐步明显。2021年全年货币政策维持稳健、灵活适度，7月份降准以置换MLF为主，12月份再次降准，一年期LPR随之下行。社融规模存量增速前三季度持续下行，四季度见底反弹，信贷结构仍存优化空间。全年流动性整体维持宽松。

2021年各期限利率债收益率较年初明显下行，全年来看2021年，利率债呈现“前高后低、中枢下行”的慢牛行情。主要影响原因有三：第一，通胀冲击，

市场对于央行因此收紧有所担忧；第二，流动性预期差，市场在偏紧和偏松的预期中转换；第三，政府债供给持续低于预期，需求端欠配，出现结构性资产荒。

2021 年信用债收益率呈波动下行走势：年初至 1 月末，资金面由松转紧、货币政策转向担忧主导收益率先下后上；春节后资金面回归平稳宽松，机构欠配压力带动信用债收益率全面下行；6 月现金管理类理财新规出台，临近半年末资金面有所收敛，市场流动性收紧预期升温叠加止盈情绪收益率多数上行；7 月全面降准超预期落地、市场做多情绪快速释放，信用债收益率大幅下行；8-10 月中旬理财净值化整改提速，房企信用风险事件频发加剧市场恐慌，大宗商品价格冲高推升通胀预期，信用债收益率跟随利率债明显上行；10 月中旬至年末，理财净值化转型尾声，能耗双控纠偏、PPI 见顶回落，二次降准兑现、货币政策宽松预期增强，收益率走势震荡。

2021 年城投债融资政策持续收紧，从交易所的“红黄绿”分档、限制弱资质平台发债到银保监会 15 号文、交易所的窗口指导再到证监会明确禁止金交所为城投公司融资，均体现了对中央“抓实化解地方政府隐性债务风险工作”要求的落实。从信用利差来看，2021 年中高评级城投债信用利差走势高度一致、震荡下行，而低评级城投债信用利差 10 月中旬前高位震荡、随后快速压缩。区域利差方面，与上年末相比多数省份信用利差收窄，收窄幅度最大的前 5 个省份为内蒙古、湖北、江苏、安徽、湖南，仅青海、宁夏、天津、云南、贵州、辽宁六省城投债信用利差走阔。

产业债方面产业债方面，2021 年多数行业净利润及现金流同比改善，与去年相比分化明显，受煤炭、钢铁等大宗商品价格上涨影响，过剩行业盈利状况明显好转。四季度以来除汽车行业信用利差走阔外，其余行业信用利差均有收窄，钢铁、化工、煤炭开采、采掘行业利差压缩最为明显。

2、投资策略

基础配置盘策略——杠杆套息策略：2021 年资金面整体延续平衡状态，资金成本仍处于较低水平，资产收益率有所波动，信用债收益收益率与资金利率之间的息差水平仍存，结合信用策略仍有一定的杠杆息差操作空间。

基础配置盘策略——信用策略：投资信用状况良好的信用类债券。通过对宏观经济、行业和企业财务状况进行分析，对固定收益品种的信用风险进行度

量及定价，利用市场对信用利差定价的相对失衡，挖掘具有估值优势的品种进行投资。重点选择具备以下特征的债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善，以及价值尚未被市场充分发现的个券。

收益增强策略——套利交易策略：此策略目标是在不增加组合整体市场风险的基础上，通过对于各类资产相对价格变动的判断，及时对产品持仓进行调整，以获得未来资产相对价格变动的收益，管理人将根据资产间的相对价格确定入场及平仓的时机。如利率债交易策略、骑乘策略、收益率曲线套利策略、信用利差套利策略、个券套利策略等。

3、实际操作

2021 年资金市场虽然存在一定波动，但全年流动性整体仍维持平衡水平，对此我们将产品杠杆率控制在合理区间，并严选资质优秀的信用债进行配置，以获得杠杆息差提升收益。

择券方面，我们通过挖掘价值被市场低估、存续期内风险可控的信用债，同时辅以交易时间把控，取得稳健收益。城投债方面虽然隐债严控、平台融资约束等政策影响下部分地区城投融资环境难言好转，但部分地区成立保障基金，增强市场沟通，彰显了底线思维下地方政府和平台对公开债券的偿付意愿。在此环境下我们发挥信用研究优势，谨慎下沉，挖掘尚有投资价值的城投债资产。

产业债方面前三季度碳中和限产政策影响下，煤炭生产受到限制，煤炭价格快速上行，四季度虽然煤炭价格有所回落，但长协下对于煤企中长期稳定盈利有正向作用。同样受生产限制以及下游需求旺盛影响，钢铁行业全年盈利有所好转。2021 年上半年我们在煤炭钢铁等盈利明显改善的行业提前进行布局，在信用风险可控的基础上提升产品配置盘收益，同时享受到了相关债券收益率下行带来的资产升值收益。

投资操作上我们积极主动，结合宏观分析预测未来经济大趋势，提前研判市场行情，并紧跟监管、市场风格变化，对持仓组合进行即使调整，以博取资产相对价格变动的收益。2021 年债市收益率整体下行，我们及时根据市场对持仓进行调整，把握债券牛市带来的整体性机会。

在信评方面我们不断提高入池标准，从个券、主体等多方面综合评估，缩小信用风险敞口，提升整体持仓稳定性。

4、未来展望

预计 2022 年全球范围内随着疫情“黑天鹅”落地，经济增速将逐渐回归常态。主要经济体将更加从容应对疫情，把政策重点放在经济复苏、抑制高通胀等主要经济目标上，经济延续复苏，但经济增速会减缓，而新兴市场和发展中国家产出则会低于疫情前趋势水平，全球经济恢复将陷入分化局面。随长期刺激以及生产恢复缓慢，全球范围内通胀高企，多数央行进入加息周期，未来经济面临的“滞胀”风险加大。

2022 年中国经济面临的环境依然复杂多变，国内环境在房地产下行、出口增速可能回落、加快经济转型带来的阵痛等多种不利因素叠加下，经济增速有进一步放缓的可能性。但同时经济下行空间也较为有限，中央政府已经注意到经济面临压力，未来政策支持力度加大，经济新动能转换，叠加新旧能源转型带来的预期拉动，增速处于底部的消费、基建投资、制造业投资等需求预期提升或将成为未来经济反弹的主要推动力。近期宏观数据也表明，疲软的内需已经出现边际改善现象，预计未来将持续。此外，尽管新冠疫情仍在全球蔓延，国内也面临较大防控压力，近期疫情散点爆发严重，但我们预计随这一波高峰过去，疫情不再会成为经济增长的主要掣肘。整体看，2022 年经济增长趋势或与今年相反，呈前低后高、筑底反弹态势。

经济下行压力结合换届年份稳增长诉求较强，预计 2022 年上半年稳增长政策将较为集中，稳增长仍将以财政政策为主。货币政策维持稳健灵活，对财政政策提供支持。具体看货币政策仍存宽松空间，但大幅宽松的幅度有限，宽信用下房地产相关融资将边际转暖。

2022 年，长端利率继续下行的空间和动能有限，存在一定的向上调整风险。当前 10 年期国债收益率已处于较低位置，货币宽松预期的博弈和发酵，是利率短期顺风下行的动力。但是包括经济数据等诸多信号已经开始释放基本面转暖的信号；宏观政策方向，尤其是财政、信贷政策已经出现拐点。一季度财政、信贷“靠前”发力，宽货币领先下宽信用逐步跟随，未来的“逆周期政策”预计以“宽信用”为主，显然，如果“宽信用”空间大于“宽货币”，对未来债券市场的走势相对不利。若二季度降息预期落地，可能就是本轮周期中债市的最后一涨。但即使二季度央行未能进一步宽松，那么随着宽信用效果逐渐显现，10 年国债下行空间也被封死，国债利率或存在反弹压力。

2022 年整体信用环境有望改善，预计违约风险相对可控，城投债把控久期、

资质和品种。稳增长诉求下财政政策发力尤其是基建托底经济作用凸显，城投作为基建、保障房、乡村振兴、城市更新项目的重要参与者，短期地位难以撼动，承担重大项目、建设职能突出的核心平台相较于业务边缘、定位模糊的非主平台安全性更高。建议规避过往融资激进、负面舆情频发、债务负担沉重的网红区域，经济发达区域切割尾部平台，安徽、河南等中部省份债务水平处于中位数上下且利差尚有空间具备性价比。

产业债聚焦煤、钢。产业债“双碳”政策纠偏、长协基准价上调，煤炭行业发展稳中向好，关注钢企兼并重组提速中的投资机会。中央经济工作会议明确了煤炭在我国的基础能源地位，强调双碳工作推进节奏的把控，近期政府工作报告中也提到能耗强度目标在“十四五”规划期内统筹考核，并留有适当弹性。煤炭长协基准价上调，预计 2022 年煤价将维持在相对较高的水平，煤企盈利空间有一定保障。当前钢铁行业集中度距目标值尚有较大差距，未来钢企兼并重组提速可期，龙头企业的抗风险能力有望进一步增强，被合并方可能获得股东支持并改善信用资质，可关注相关受益标的。地产债方面，政策筑底传导至基本面、市场信心恢复存在时滞，分化过程中优胜劣汰、风险出清将持续，关注发展稳健、信用资质良好的央企国企。

（二）内部性声明

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人设立独立的合规部与风险管理部，对集合资产管理业务相关风险进行全面的监控、监督、检查和评价。

合规部主要对业务部门提交用印的材料进行合规审核，对集合资产管理业务操作过程中的合规风险进行评估，定期或不定期对资管业务部门开展合规检查，对集合资产管理业务的合规风险进行识别、评估、控制和报告。

风险管理部主要对公司各项资产管理计划进行实时监控，对集合资产管理计划的信用风险、市场风险、操作风险等进行监测、识别和评估，按月编制集合资产管理业务风险控制报告。

日常管理过程中，合规部与风险管理部及时进行合规风险和相关风险提示，提出合规管理与风险管理建议，并督促相关业务部门及时整改。

通过监控和检查，可以确认，在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和本集合计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

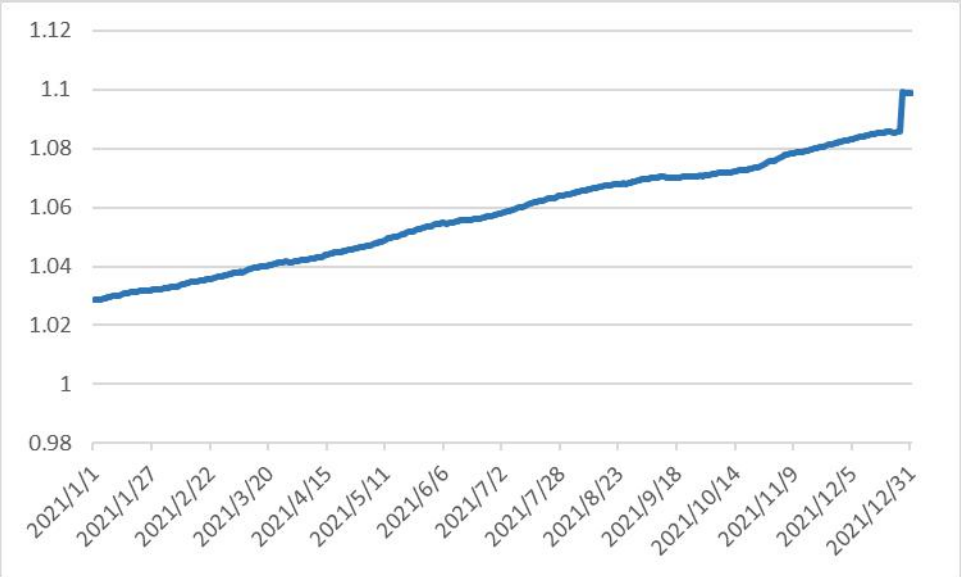
三、集合计划投资表现

（一）主要财务指标：

单位：人民币元

	主要财务指标	2021 年 12 月 31 日
1	实收资本	83,245,719.50
2	集合计划资产净值	91,484,319.25
3	单位集合计划资产净值	1.0990
4	累计单位集合计划资产净值	1.0990

（二）鑫航季季添金 2 号产品单位净值表现图



数据来源：中航证券官网披露单位净值

四、集合计划投资组合报告

2021 年 12 月 31 日　　单位：人民币元

1、资产组合情况

项目	期末市值（元）	市值占净值%
银行存款	242,489.22	0.2651
债券投资	121,606,405.00	132.9260
其他资产	5,657,673.18	6.1843
资产类合计	127,506,567.40	139.38

备注：因四舍五入原因，资产组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

2、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名证券明细

序号	证券代码	证券名称	数量	市值	市值占净值%
1	102101926.IB	21 鲁钢铁 MTN002	140,000	14,113,400.00	15.4271
2	177023.SH	20 新高 01	100,000	10,226,000.00	11.1779
3	167954.SH	G20 嵊交 1	100,000	10,217,000.00	11.1680
4	177057.SH	20 新集 02	100,000	10,195,000.00	11.1440
5	102100273.IB	21 涪陵新城 MTN001	100,000	10,169,000.00	11.1156

注：其中数量（股）为四舍五入的整数。

五、集合计划报告期内杠杆运用情况

截至 2021 年 12 月 31 日，中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划资产总值为 12750.66 万元，占资产净值比例为 139.38%，杠杆全部用于购买符合标准的资产。

六、集合计划报告期内费用情况

费用明细	计提基准	计提方式	支付方式
管理费	H=E×0.3%÷365 H为每日应计提的集合计划管理费 E 为前一日集合计划资产净值	每日计提	按月支付
托管费	H ＝ E×0.01%÷365 H 为每日应计提的托管费 E 为前一日集合计划资产净值	每日计提	按月支付
业绩报酬	管理人在发生业绩报酬计提基准调整时，公告新的业绩报酬计提基准，在下一次业绩报酬计提基准调整之前，都以该业绩报酬计提基准计提业绩报酬。	年化实际收益率低于管理人公布的业绩报酬计提基准时，管理人不收取业绩报酬，年化收益高于管理人公布的业绩报酬计提基准以上的部分，管理人收取 60%的业绩报酬。	提取频率不超过每 6 个月一次。

七、集合计划财务会计报告

1、资产负债表

日期：2021 年 12 月 31 日　　单位：人民币元

资产	期末余额	年初余额	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资　产：			**负　债：**		
银行存款	242,489.22	455,739.79	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	0.00	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	0.00	129.25	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	121,606,405.00	105,402,500.00	卖出回购金融资产款	35,879,208.10	29,539,137.44
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清算款	0.00	0.00
债券投资	121,606,405.00	105,402,500.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00	应付管理人报酬	22,783.75	19,655.89
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	759.47	655.19
资产支持证券投资	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00	应付交易费用	6,590.24	22,624.61
买入返售金融资产	0.00	0.00	应交税费	66,089.61	16,448.19
应收证券清算款	0.00	0.00	应付利息	36,916.98	29,688.14
应收利息	2,367,673.18	1,852,066.76	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	其他负债	9,900.00	9,900.00
应收申购款	3,290,000.00	600,000.00	**负债合计**	36,022,248.15	29,638,109.46
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益：		
			实收基金	83,245,719.50	76,501,645.01
			未分配利润	8,238,599.75	2,170,681.33
			所有者权益合计	91,484,319.25	78,672,326.34
资产合计	127,506,567.40	108,310,435.80	**负债和所有者权益总计**	127,506,567.40	108,310,435.80

2、损益表

日期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日　　单位：人民币元

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	7,893,365.99	1,481,886.91
2	1、利息收入	6,298,461.91	1,394,347.07
3	其中：存款利息收入	34,234.62	17,423.18
4	债券利息收入	6,364,054.26	1,329,902.54
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	85,131.22	85,421.30
7	利息收入增值税抵减	-184,958.19	-38,399.95
8	2、投资收益	322,680.78	30,183.53
9	其中：股票投资收益	0.00	0.00
10	债券投资收益	332,361.20	-1,794.25
11	基金投资收益	0.00	0.00
12	权证投资收益	0.00	0.00
13	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
14	衍生工具收益	0.00	0.00
15	股利收益	0.00	31,977.78
16	个股期权收益	0.00	0.00
17	投资收益增值税抵减	-9,680.42	0.00
18	3、公允价值变动收益	1,272,223.30	57,356.31
19	4、其他收入	0.00	0.00
20	二、费用	1,508,150.83	379,363.53
21	1、管理人报酬	293,917.21	70,050.19
22	2、托管费	9,797.25	2,335.04
23	3、销售服务费	0.00	0.00
24	4、交易费用	4,932.14	9,873.84
25	5、利息支出	1,152,504.23	286,804.46
26	其中：卖出回购金融资产支出	1,152,504.23	286,804.46
27	6、其他费用	47,000.00	10,300.00
28	三、增值税税金及附加税	27,936.64	4,814.46
29	四、利润总和	6,357,278.52	1,097,708.92

3、所有者权益变动表

日期：2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日
单位：人民币元

项目	本期金额			上期金额		
	实收基金	未分配利润	所有者权益	实收基金	未分配利润	所有者权益
一、期初所有者权益（基金净值）	76,501,645.01	2,170,681.33	78,672,326.34	25,490,884.62	0.00	25,490,884.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	6,357,278.52	6,357,278.52	0.00	1,097,708.92	1,097,708.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（减少以"－"号填列）	6,744,074.49	-289,360.10	6,454,714.39	51,010,760.39	1,072,972.41	52,083,732.80
其中：1.基金申购款	148,266,356.46	8,483,643.54	156,750,000.00	58,509,912.92	1,260,087.08	59,770,000.00
2.基金赎回款	-141,522,281.97	-8,773,003.64	-150,295,285.61	-7,499,152.53	-187,114.67	-7,686,267.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	83,245,719.50	8,238,599.75	91,484,319.25	76,501,645.01	2,170,681.33	78,672,326.34

八、集合计划份额变动情况

本报告期内本计划份额变动情况如下：

单位：份

期初总份额	期间参与份额	期间退出份额	期末总份额
76,501,645.01	148,266,356.46	141,522,281.97	83,245,719.50

九、集合计划报告期内投资收益分配情况

报告期内不存在收益分配情况（提取情况）

十、重要事项揭示

（一）在本报告期内，本集合计划管理人董事长变更为丛中，总经理无变更；托管人的董事长、总经理无变更。

（二）在本报告期内，本集合计划投资经理无变更。

（三）在本报告期内，本集合计划管理人三分之一以上的董事、监事无变动。

（四）在本报告期内，本集合计划存在买入关联方证券（南银转债）的关联交易，但无重大关联交易等其他涉及投资者权益的重大事项。

（五）截至 12 月 31 日，中航证券从业人员及其配偶（投资主办跟投）参与本集合计划，占比 0.67%。

（六）自 2022 年 1 月 1 日起，中航证券有限公司 （下称“我司”）将对目前公司管理的资产管理产品执行新金融工具相关会计准则实施的政策。我司于 2021 年 12 月 27 日已对所管理的全部资产管理计划债券估值方法进行变更。因相关会计准则变化导致执行的估值原则及方法与已签署的资产管理合同及补充协议不一致的，以通知及相关规范要求明确的新估值原则为准。相关公告及通知详见公司官网《关于中航证券有限公司管理的集合资产管理计划估值方法变更的公告》《中航证券有限公司关于资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的通知》。

十一、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

1. 《关于中航证券有限公司法定代表人变更的公告》
2. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 1231》
3. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划 2020 年第 4 季度资产管理报告》
4. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划-2020 年第四季度-托管人报告》
5. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他

关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 210131》

6. 《关于中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划业绩报酬计提基准调整的公告 2103》
7. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 210228》
8. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 210331》
9. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划 2020 年年度资产管理报告》
10. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划-2020 年年度-托管人报告》
11. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划 2021 年第 1 季度资产管理报告》
12. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划-2021 年第一季度-托管人报告》
13. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 210430》
14. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 210531》
15. 《【20210616】中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划投资关联方证券公告》
16. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 210630》
17. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划 2021 年第 2 季度资产管理报告》
18. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划-2021 年第二季度-托管人报告》
19. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 210731》
20. 《关于中航证券季季添金 2 号集合资产管理计划业绩报酬计提基准调整的公告》-2021.08.26
21. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他

关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 210831》

22. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 210930》
23. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划 2021 年第 3 季度资产管理报告》
24. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划-2021 年第三季度-托管人报告》
25. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 211031》
26. 《关于董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与公司设立的集合资产管理计划的公告 211130》
27. 《关于中航证券有限公司管理的集合资产管理计划估值方法变更的公告》
28. 《中航证券有限公司关于资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的通知》
29. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划资产管理合同》
30. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划说明书》
31. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划托管协议》
32. 《中航证券鑫航季季添金 2 号集合资产管理计划风险揭示书》
33. 本报告期内所有开放期及业绩基准公告
34. 管理人业务资格批件、营业执照
35. 其他报告期官网披露的文件

（二）查阅方式

网址：www.avicsec.com

信息披露电话：010-59562622

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人中航证券有限公司。

中航证券有限公司

二零二二年四月三十日