

中航航行宝货币市场基金 2023 年第 2 季度报告

2023 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

报告送出日期：2023 年 7 月 20 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 2023 年 7 月 18 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	1,042,016,078.35 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</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</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	
下属分级基金的基金简称	中航航行宝 A	中航航行宝 B
下属分级基金的交易代码	004133	015972
报告期末下属分级基金的份额总额	44,389,404.10 份	997,626,674.25 份

注：本基金 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续。

§ 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（2023 年 4 月 1 日 — 2023 年 6 月 30 日）	
	中航航空宝 A	中航航空宝 B
1. 本期已实现收益	254,566.79	5,891,178.29
2. 本期利润	254,566.79	5,891,178.29
3. 期末基金资产净值	44,389,404.10	997,626,674.25

注：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

中航航空宝 A

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	0.5620%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.2254%	0.0010%
过去六个月	1.0889%	0.0010%	0.6695%	0.0000%	0.4194%	0.0010%
过去一年	1.9797%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.6297%	0.0015%
过去三年	5.8961%	0.0014%	4.0500%	0.0000%	1.8461%	0.0014%
过去五年	10.6601%	0.0018%	6.7537%	0.0000%	3.9064%	0.0018%
自基金合同 生效起至今	16.7023%	0.0032%	8.6844%	0.0000%	8.0179%	0.0032%

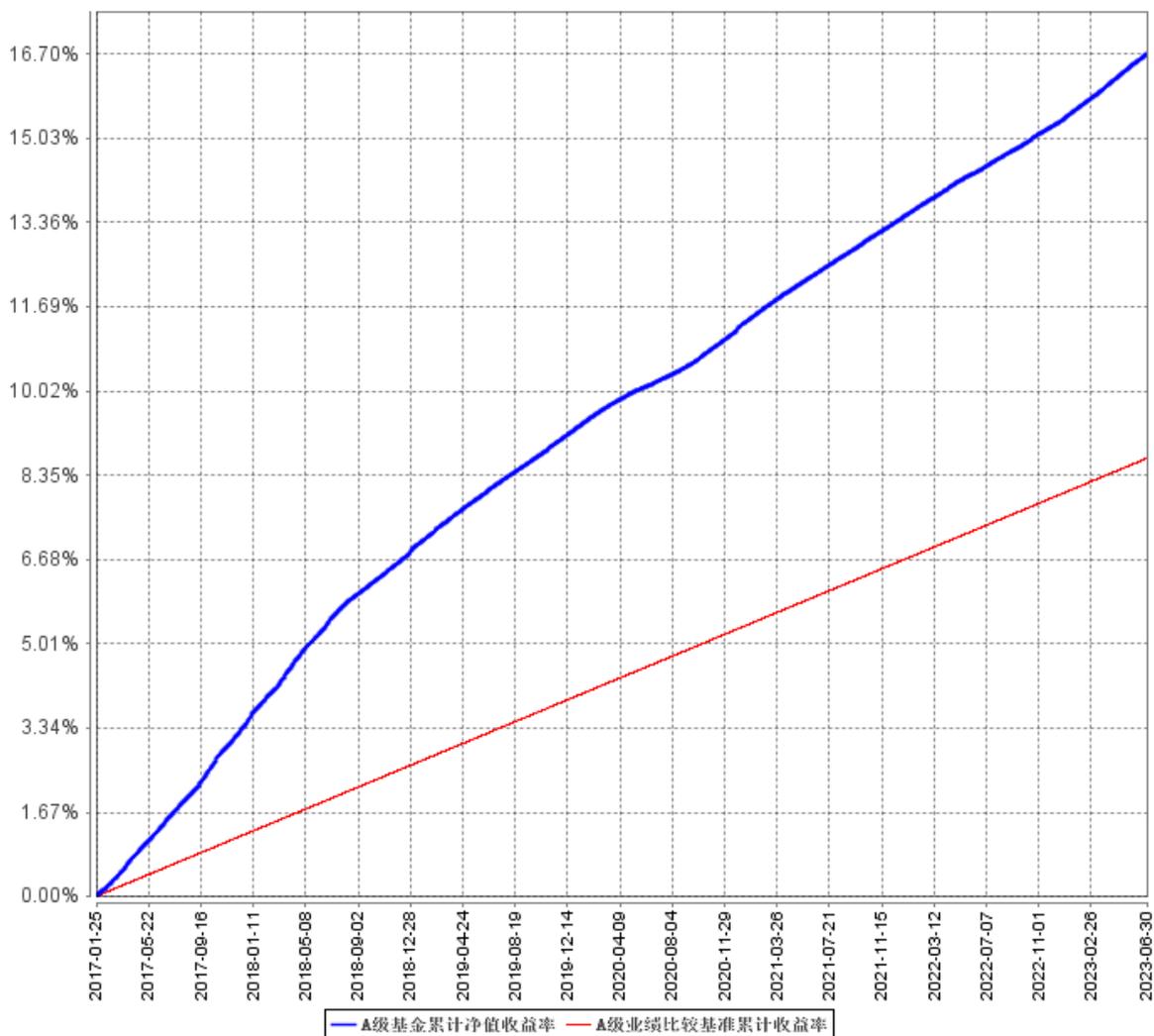
中航航空宝 B

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	0.5970%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.2604%	0.0010%
过去六个月	1.1589%	0.0010%	0.6695%	0.0000%	0.4894%	0.0010%
过去一年	2.1221%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.7721%	0.0015%
自基金合同 生效起至今	2.1642%	0.0015%	1.3759%	0.0000%	0.7883%	0.0015%

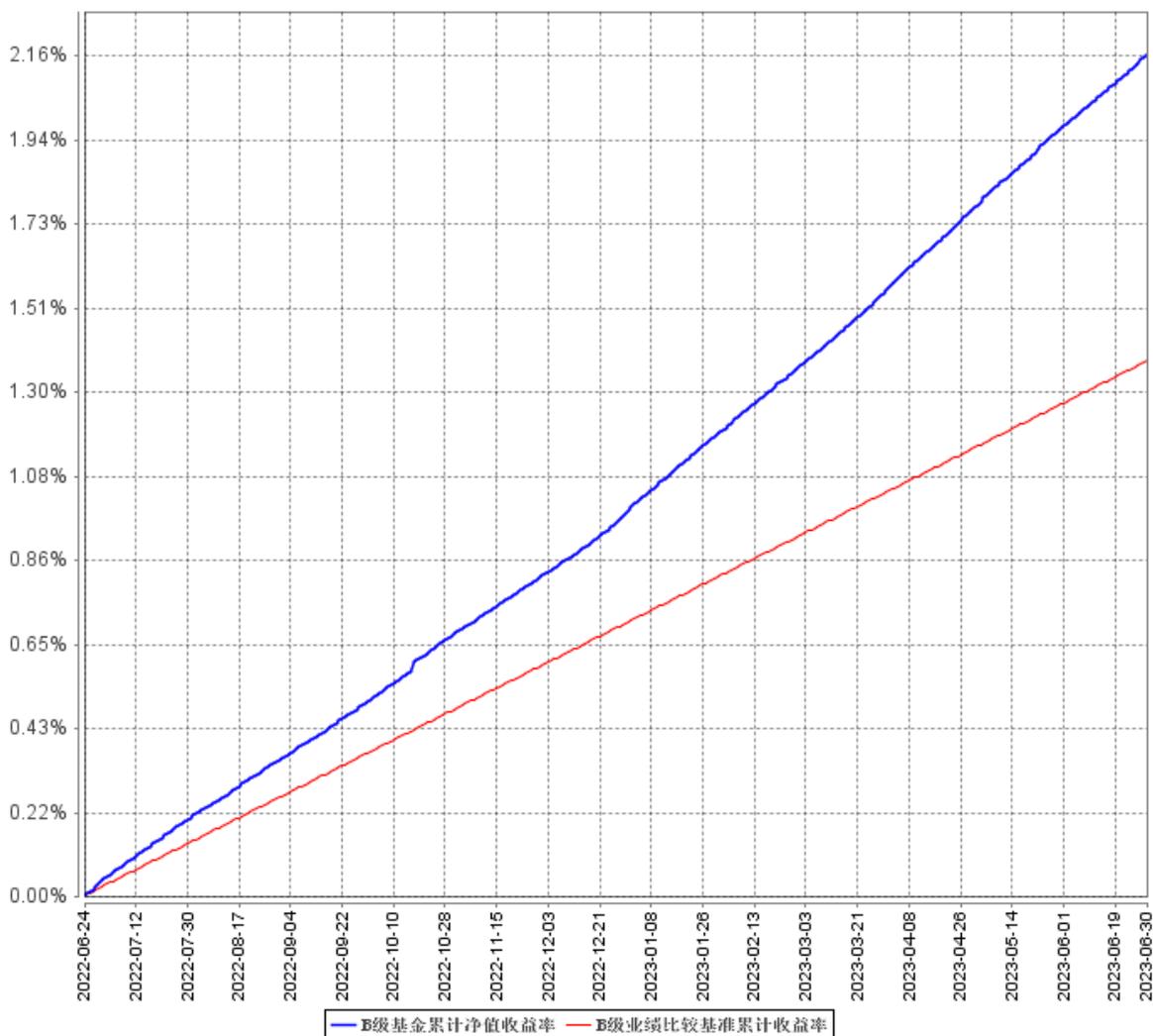
注：本基金 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续。

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

A级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



B级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



注：本基金 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续。

§ 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	-	5	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。

李祥源	基金经理	2022 年 5 月 23 日	-	8	硕士研究生，曾任职于泰达宏利基金管理有限公司固定收益部，先后担任助理研究员、研究员、分析师、基金经理助理、基金经理。2021 年 12 月加入中航基金管理有限公司，现担任固定收益部基金经理。
-----	------	--------------------	---	---	---

注：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

报告期内，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。

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

报告期内，债券资产表现强劲，各期限收益率稳步下行，短端下行幅度较大，长端和超长端表现同样亮眼，收益率曲线有所陡峭化。二季度债市的主线是强预期的失效和盼降息的落地，二季度金融数据依旧不弱，但地产的强刺激政策未能落地，市场对于降息的预期逐渐升温，偏弱的现实给债市打开了上涨的空间，六月降息落地后市场对宽信用的偏空情绪占据主导，债市收益率有所波动。二季度 CPI 和 PPI 表现符合预期，通胀压力不大。二季度 OMO、MLF 和 LPR 等利率都迎来了下调，市场资金面平稳，跨时点资金量足价高，货币政策保持稳健。二季度信用债市场继续修复，企业净融资逐步转正。二季度美联储货币政策仍维持收紧，美国通胀压力仍在，但美国经济韧性尚可，我国汇率会阶段性承压，欧盟地区经济未见起色，整体外围对国内货币政策掣肘有限。二季度债市整体表现良好，理财资金的申赎基本维持净申购，资产买入方结构愈发多元化，多空力量相对均衡。二季度资金市场较为宽松，央行在关键时点呵护积极，货币类资产表现较好。

本组合在报告期内仍主要投资于同业存单、高等级信用债等流动性较好的资产，剩余期限维持在较短水平，杠杆水平不高。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内中航航行宝 A 的基金份额净值收益率为 0.5620%，本报告期内中航航行宝 B 的基金份额净值收益率为 0.5970%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

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	561,322,235.63	50.49
	其中：债券	561,322,235.63	50.49
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	377,731,291.24	33.97
	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	171,985,827.74	15.47
4	其他资产	798,473.00	0.07
5	合计	1,111,837,827.61	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	5.25	
	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	69,424,069.49	6.66
	其中：买断式回购融资	-	-

注：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	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

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	57.46	6.66
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	21.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	6.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

4	90 天(含)-120 天	5.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	15.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.29	6.66

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	61,806,034.61	5.93
	其中：政策性金融债	61,806,034.61	5.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,924,718.02	9.69
6	中期票据	-	-
7	同业存单	398,591,483.00	38.25
8	其他	-	-
9	合计	561,322,235.63	53.87
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	112396625	23 广州农村商业银行 CD038	500,000	49,959,322.00	4.79
2	112321154	23 渤海银行 CD154	500,000	49,941,494.33	4.79
3	112310141	23 兴业银行 CD141	500,000	49,937,206.22	4.79
4	112205131	22 建设银行 CD131	500,000	49,891,397.83	4.79
5	112319181	23 恒丰银行 CD181	500,000	49,835,645.99	4.78
6	112209167	22 浦发银行 CD167	500,000	49,627,093.82	4.76
7	112315069	23 民生银行 CD069	500,000	49,539,444.42	4.75
8	200207	20 国开 07	400,000	41,109,361.99	3.95
9	180211	18 国开 11	200,000	20,696,672.62	1.99
10	072310070	23 华福证券 CP001	200,000	20,112,728.05	1.93

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	0.0743%
报告期内偏离度的最低值	0.0294%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0547%

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

23 广州农村商业银行 CD038（代码：112396625）

2022 年 8 月 15 日，中国银保监会广东监管局对广州农村商业银行同业及理财业务严重违反审慎经营规则，配合现场检查不力，罚款 920 万元。

23 渤海银行 CD154（代码：112321154）

2023 年 2 月 28 日，中国人民银行对渤海银行违反存款准备金管理规定；违反账户管理规定；违反清算管理规定；违反人民币反假有关规定；占压财政存款或者资金；违反国库科目设置和使用规定；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；违反征信安全管理规定；未按规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户，警告，没收违法所得 106.98706 万元，并处罚款 1589.486898 万元。

2023 年 2 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对渤海银行风险加权资产计算不准确、流动性风险指标计算不准确、全部关联度计算不准确、未准确反映信用风险信息、未准确反映国别风险信息、股权质押业务错报、理财业务数据错报、主要股东数据错报、大中小微型企业贷款、

普惠型消费贷款数据错报、投资数据错报、同业交易对手错报、数据治理机制不健全、制度建设和信息系统建设不到位，罚款 860 万元。

2023 年 2 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会对渤海银行小微企业贷款风险分类不准确、小微企业贷款资金被挪用于购买理财产品、将银行员工、公务员等个人商用房贷款计入普惠型个体工商户或小微企业主贷款统计口径、将非小微企业划归统计口径、违规发放商用房贷款，对总行罚款 430 万元，对分支机构罚款 1230 万元，合计罚款 1660 万元。

23 兴业银行 CD141（代码：112310141）

2022 年 9 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行老产品规模在部分时点出现反弹；未按规定开展理财业务内部审计；同业理财产品未持续压降；单独使用区间数值展示业绩比较基准；理财托管业务违反资产独立性原则要求，罚款 450 万元。

2022 年 9 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行债券承销业务严重违反审慎经营规则，罚款 150 万元。

22 建设银行 CD131（代码：112205131）

2023 年 5 月 11 日，基于监管部门反馈线索，依据《银行间债券市场自律处分规则》，交易商协会已对建设银行债务融资工具承销业务涉嫌违规行为开展自律调查。

2023 年 2 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会对建设银行公司治理和内部控制制度与监管规定不符、监管发现问题屡查屡犯或未充分整改、向检查组提供企业出具的虚假证明材料、未按规定及时报送案件信息、违规发放房地产贷款、贷款审查严重不尽职，违规办理虚假按揭贷款、违规发放固定资产贷款、违规为地方政府融资平台提供融资，后期以流动资金贷款承接前期融资、信用卡资金违规流入证券公司、违反产业政策为“两高一剩”企业提供融资、小微企业统计数据与事实不符，企业划型不准确，将大中型企业纳入小微企业统计、小微快贷业务违反审慎经营规则、违规收取民营企业、小微企业费用、违规借贷搭售理财产品、精准扶贫小额贷款资金违规归集使用、向关系人发放信用贷款、违规发放贷款掩盖风险、违规变相突破单一法人客户授信额度限制、搭桥贷款业务不合规、流动资金贷款管理违反审慎经营规则、固定资产贷款管理违反审慎经营规则、并购贷款管理违反审慎经营规则、个人贷款管理严重违反审慎经营规则、理财业务风险隔离不符合监管规定、理财业务投资运作不合规、违规通过理财业务实现不良资产虚假出表、违规虚增资本、面向一般个人客户销售的理财产品资金流向不符合规定，违规投资权益类资产、理财产品信息登记不及时，部分产品未登记底层资产、理财业务统计数据与事实不符、理财资金

投资非标准化债权资产的余额超过监管比例要求、同业投资业务管理违反审慎经营规则、债券投资业务未准确计量风险，个别债券风险加权资产计提比例低于监管要求、串用银行承兑汇票保证金掩盖信用风险、贴现资金违规回流出票人、违规向委托贷款借款人收取手续费、对信用卡业务异常交易行为监控不力导致频繁套现、银行集团并表统一授信管理流于形式，没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元，其中，总行 7341.5626 万元，分支机构 12550 万元。

2022 年 9 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会对建设银行老产品规模在部分时点出现反弹，罚款 200 万元。

2022 年 9 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对建设银行个人经营贷款“三查”不到位、个人经营贷款制度不审慎、总行对分支机构管控不力承担管理责任，罚款 260 万元。

22 浦发银行 CD167（代码：112209167）

2022 年 10 月 26 日，中国银行间市场交易商协会自律处分信息显示，浦发银行作为债务融资工具主承销商，在为发行人衢州市国有资本运营有限公司提供中介服务过程中，存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为：一是对衢州国资相关债务融资工具募集资金使用情况监测和督导不到位。二是尽职调查报告形式不完整，未充分反映尽职调查的过程和结果。根据银行间债券市场相关自律规定，经自律处分会议审议，对浦发银行予以诫勉谈话；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。

2022 年 9 月 2 日，国家外汇管理局上海市分局对浦发银行违规办理远期结汇业务，违规办理期权交易，违规办理内保外贷业务，违规办理房产佣金收、结汇业务，结售汇统计数据错报，责令改正，给予警告，处罚款 933 万元人民币，没收违法所得 334.69 万元人民币。

2022 年 8 月 17 日，上海市市场监督管理局对浦发银行将奥林匹克标志用于广告宣传、商业展览、营业性演出以及其他商业活动中，罚款 0.5 万元。

23 民生银行 CD069（代码：112315069）

2023 年 5 月 9 日，依据《银行间债券市场自律处分规则》，中国银行间市场交易商协会针对民生银行承销业务涉嫌违规行为已开展自律调查。

2023 年 2 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会对民生银行小微企业贷款风险分类不准确、小微企业贷款资金被挪用于房地产领域、小微企业贷款资金被挪用于银承保证金、小微企业贷款资金被挪用于定期存款并滚动办理质押贷款、小微企业贷款资金被挪用于购买本行理财产品、小微企业贷款统计数据不真实、未对集团客户、法人企业与企业关系人进行统一授信、向小微企业

贷款客户转嫁抵押登记费、向小微企业贷款客户转嫁抵押评估费、向小微企业收取银行承兑汇票敞口额度占用费、中长期贷款违规重组且贷款分类不实、重大关联交易未经董事会审议、大连小微企业金融服务中心违规办理业务、信贷档案丢失，贷后管理存在重大漏洞，对民生银行总行罚款 6670 万元，没收违法所得 2.462 万元，对民生银行分支机构罚款 2300 万元，共计罚款 8970 万元，没收违法所得 2.462 万元。

本基金投资 23 广州农村商业银行 CD038、23 渤海银行 CD154、23 兴业银行 CD141、22 建设银行 CD131、22 浦发银行 CD167、23 民生银行 CD069 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金除 23 广州农村商业银行 CD038、23 渤海银行 CD154、23 兴业银行 CD141、22 建设银行 CD131、22 浦发银行 CD167、23 民生银行 CD069 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。

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	-
4	应收申购款	798,473.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	798,473.00

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航航行宝 A	中航航行宝 B
报告期期初基金份额总额	36,938,505.66	1,062,719,188.40
报告期期间基金总申购份额	55,029,381.33	168,458,545.27
报告期期间基金总赎回份额	47,578,482.89	233,551,059.42
报告期期末基金份额总额	44,389,404.10	997,626,674.25

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投	-	900,387.52	-	-
合计			900,387.52	-	

注：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	20230401-20230630	300,673,071.38	1,796,186.43	2,200,000.00	300,269,257.81	28.82%
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

1. 中国证监会批准中航航空宝货币市场基金募集的文件
2. 《中航航空宝货币市场基金基金合同》
3. 《中航航空宝货币市场基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照

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

9.2 存放地点

中航基金管理有限公司，地址：北京市朝阳区天辰东路 1 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801\805\806 单元。

9.3 查阅方式

1. 营业时间内到本公司免费查阅
2. 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.avicfund.cn
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

2023 年 7 月 20 日