

中航华证商飞高端制造产业主题指数型发 起式证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：南京银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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、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 2026 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	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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	44

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 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情况	46
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	46
§ 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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金	
基金简称	中航华证商飞高端制造产业指数发起	
基金主代码	017651	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 7 日	
基金管理人	中航基金管理有限公司	
基金托管人	南京银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	178,093,583.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中航华证商飞高端制造产业指数发起 A	中航华证商飞高端制造产业指数发起 C
下属分级基金的交 易代码	017651	017652
报告期末下属分级 基金的份额总额	63,629,838.23 份	114,463,744.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1. 大类资产配置；2. 股票投资策略（1）股票投资组合构建（2）股票投资组合的调整；3. 债券投资策略；4. 股指期货投资策略；5. 国债期货投资策略；6. 资产支持证券投资策略；7. 存托凭证投资策略；8. 可转换债券、可交换债券投资策略；9. 证券公司短期公司债券投资策略；10. 参与融资及转融通证券出借业务策略
业绩比较基准	华证商飞高端制造产业主题指数收益率 $\times 95\%$ +同期银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	南京银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	宋鑫	王峰
	联系电话	010-56716167	021-24198808
	电子邮箱	songxin@avicfund.cn	wangf3@njcb.com.cn
客户服务电话		400-666-2186	95302
传真		010-56716198	025-86776189
注册地址		北京市石景山区五一剧场南路 2	南京市建邺区江山大街 88 号

	号院 1 号楼 7 层 702E	
办公地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号院亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元	南京市建邺区江山大街 88 号
邮政编码	100101	210019
法定代表人	杨彦伟	谢宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金中期报告置备地点	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	北京市朝阳区天辰东路 1 号院亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元

§ 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	中航华证商飞高端制造产业指数发起 A	中航华证商飞高端制造产业指数发起 C
本期已实现收益	-7,571,279.24	-14,470,186.49
本期利润	-15,492,673.36	-33,462,541.30
加权平均基金份额 本期利润	-0.2523	-0.2900
本期加权平均净 值利润率	-24.85%	-28.82%
本期基金份额净 值增长率	-11.26%	-11.37%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-11,739,169.39	-21,890,364.03
期末可供分配基 金份额利润	-0.1845	-0.1912

期末基金资产净值	57,393,842.04	102,392,489.14
期末基金份额净值	0.9020	0.8945
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-9.80%	-10.55%

注：①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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中航华证商飞高端制造产业指数发起 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-8.08%	1.68%	-8.39%	1.73%	0.31%	-0.05%
过去六个月	-11.26%	1.93%	-12.07%	2.08%	0.81%	-0.15%
过去一年	-5.23%	1.64%	-5.56%	1.73%	0.33%	-0.09%
过去三年	-9.52%	1.70%	-12.29%	1.79%	2.77%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-9.80%	1.64%	-19.12%	1.74%	9.32%	-0.10%

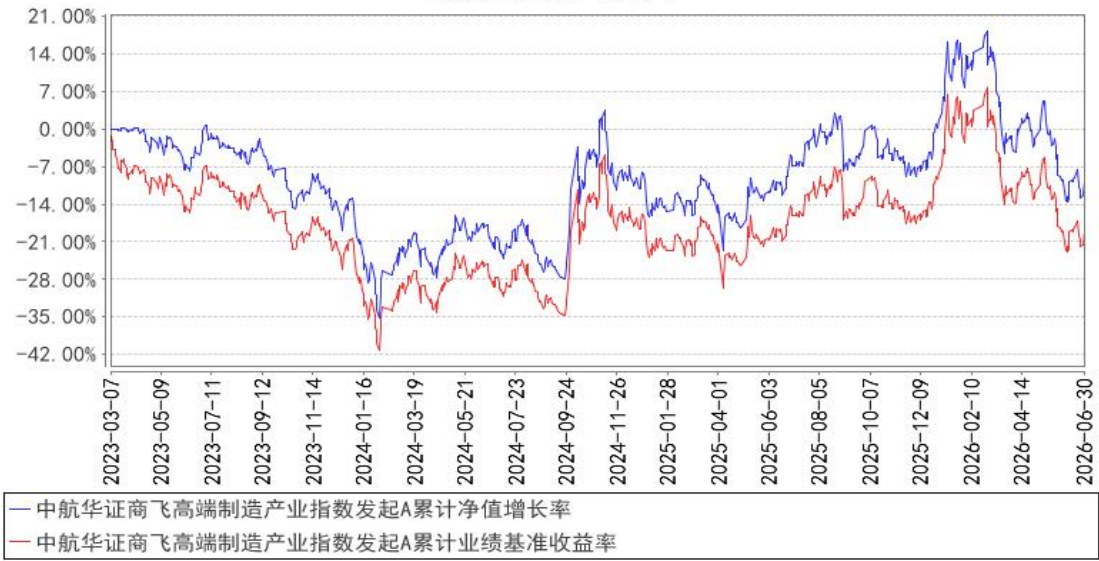
中航华证商飞高端制造产业指数发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-8.14%	1.68%	-8.39%	1.73%	0.25%	-0.05%
过去六个月	-11.37%	1.94%	-12.07%	2.08%	0.70%	-0.14%
过去一年	-5.47%	1.64%	-5.56%	1.73%	0.09%	-0.09%

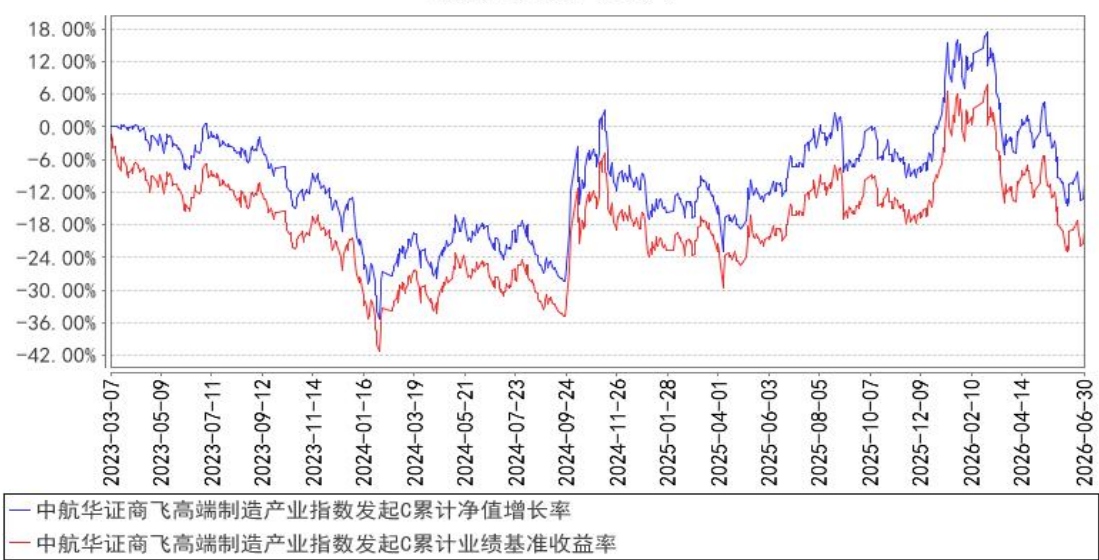
过去三年	-10.19%	1.70%	-12.29%	1.79%	2.10%	-0.09%
自基金合同生效起 至今	-10.55%	1.64%	-19.12%	1.74%	8.57%	-0.10%

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

中航华证商飞高端制造产业指数发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中航华证商飞高端制造产业指数发起C累计净值增长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。

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		
龙川	本基金的基金经理	2023 年 3 月 7 日	—	16 年	统计博士学位，具有 8 年海外投资管理经验，10 年以上国内证券、基金行业投资管理经历，曾任职于美国 Susquehanna International Group (SIG) 担任投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司担任首席研究员、上海东方证券资产管理有限公司担任量化投资总监、安信基金管理有限责任公司担任量化投资部总经理。2020 年 2 月起加入中航基金管理有限公司，现担任中航基金管理有限公司量化投资部负责人，中航基金管理有限公司上海分公司总经理。
韩浩	本基金的基金经理	2023 年 3 月 7 日	—	19 年	硕士研究生。曾供职于中国民族证券有限责任公司担任市场策略部分析师、财富中心总经理助理；金元证券股份有限公司担任首席投资顾问；中航证券有限公司担任投资主办。2016 年 9 月加入中航基金管理有限公司，现担任公司副总经理、权益投资部总经理、权益投资部基金经理。

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、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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》、《中航华证商飞高端制造产业主题指

数型发起式证券投资基金基金合同》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，力争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

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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金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 5%的情况。

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

2026 年上半年，A 股呈现“指数震荡上行、结构极致分化”格局：上证指数涨 3.16%，深证成指涨 19.82%，创业板指涨 35.58%，科创 50 大涨 64.25%。全市场资金高度向 AI 算力、半导体、通信设备、PCB 等硬科技产业链集中，电子、通信行业表现居前；国防军工板块整体相对承压，市场呈现典型“K 型分化”特征。

本基金跟踪华证商飞高端制造产业主题指数，采用完全复制法进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。指数成分股聚焦国产大飞机产业链，覆盖整机制造、航空发动机、航空复合材料、机载系统、航空零部件等高端制造领域。报告期内，基金严格按照指数成分股权重构建投资组合，应对日常申赎、成分股调整等事项，持续优化现金头寸管理，尽力控制跟踪误差，力求贴合指数收益表现，分享国内商用航空产业长期成长红利。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航华证商飞高端制造产业指数发起 A 基金份额净值为 0.9020 元，本报告期

基金份额净值增长率为-11.26%;截至本报告期末中航华证商飞高端制造产业指数发起 C 基金份额净值为 0.8945 元,本报告期基金份额净值增长率为-11.37%;同期业绩比较基准收益率为-12.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年, A 股有望延续结构性行情, 科技成长仍是市场关注主线, 但板块内行情分化加剧。上半年科技板块大幅上涨后, 部分行业估值与交易拥挤度抬升, 市场行情将逐步由主题炒作转向业绩兑现验证。

宏观层面, 国内持续推进高端制造自主化、产业链安全升级战略。航空产业方面, 国产大飞机产能持续爬坡, 交付规模稳步提升, 上游零部件国产化持续推进, 长期成长逻辑清晰。但短期板块波动仍将受到市场资金轮动、订单交付节奏、行业估值波动等因素影响。后续管理人将持续跟踪商飞交付进度、供应链国产化进展、行业订单变化等核心变量, 继续坚持被动跟踪策略, 严密监控跟踪误差, 忠实复制华证商飞高端制造产业主题指数, 力争实现紧密跟踪指数的投资目标。

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

根据本基金基金合同的相关规定, 结合本基金实际运作情况, 本基金本报告期末进行利润分配。

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

无。

§ 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，南京银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的相关规定，切实履行了受托管理职责，未出现任何损害基金份额持有人利益的行为，独立、勤勉尽责地履行了受托管理职责。

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，对本基金的投资运作实施了必要的监督。针对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、利润分配及基金费用开支等方面，本托管人进行了审慎复核，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

本报告期内，由中航基金管理有限公司编制、经本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（其中“金融工具风险及管理”部分未经本托管人复核）、投资组合报告等内容均真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§ 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：中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,131,365.29	3,215,314.59
结算备付金		9,561,197.97	1,894,267.39
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	150,506,355.09	42,689,901.43
其中：股票投资		150,506,355.09	42,689,901.43
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		565,713.78	898,639.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		163,764,632.13	48,698,123.34
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,844,525.55	2,765,499.88
应付管理人报酬		70,400.41	18,710.28
应付托管费		14,080.09	3,742.06
应付销售服务费		22,847.91	4,888.52
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	26,446.99	3,110.95
负债合计		3,978,300.95	2,795,951.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	178,093,583.15	45,322,073.14
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-18,307,251.97	580,098.51
净资产合计		159,786,331.18	45,902,171.65
负债和净资产总计		163,764,632.13	48,698,123.34

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，A 类基金份额净值 0.9020 元，C 类基金份额净值 0.8945 元；基金份额总额 178,093,583.15 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 63,629,838.23 份，C 类基金份额总额 114,463,744.92 份。

6.2 利润表

会计主体：中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-48,265,450.88	1,623,202.07
1. 利息收入		13,602.81	5,249.45
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,602.81	5,249.45
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-21,724,570.02	-869,852.66
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-22,566,225.75	-1,219,951.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	841,655.73	350,098.56
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-26,913,748.93	2,062,762.81
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	359,265.26	425,042.47
减：二、营业总支出		689,763.78	186,424.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	434,941.01	107,006.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	86,988.26	21,401.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	141,551.50	30,741.71
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	26, 283. 01	27, 274. 89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-48, 955, 214. 66	1, 436, 777. 70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-48, 955, 214. 66	1, 436, 777. 70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-48, 955, 214. 66	1, 436, 777. 70

6.3 净资产变动表

会计主体：中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	45, 322, 073. 14	-	580, 098. 51	45, 902, 171. 65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	45, 322, 073. 14	-	580, 098. 51	45, 902, 171. 65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	132, 771, 510. 01	-	-18, 887, 350. 48	113, 884, 159. 53
（一）、综合收益总额	-	-	-48, 955, 214. 66	-48, 955, 214. 66
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	132, 771, 510. 01	-	30, 067, 864. 18	162, 839, 374. 19
其中：1. 基金申购款	455, 312, 473. 06	-	43, 546, 718. 71	498, 859, 191. 77
2. 基金赎回	-322, 540, 963. 0	-	-13, 478, 854. 53	-336, 019, 817. 58

回款	5			
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	178,093,583.15	-	-18,307,251.97	159,786,331.18
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	44,328,840.52	-	-4,364,982.98	39,963,857.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	44,328,840.52	-	-4,364,982.98	39,963,857.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	11,620,624.01	-	1,468,281.85	13,088,905.86
（一）、综合收益总额	-	-	1,436,777.70	1,436,777.70
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	11,620,624.01	-	31,504.15	11,652,128.16
其中：1. 基金申购款	137,966,046.85	-	-15,652,007.63	122,314,039.22
2. 基金赎回款	-126,345,422.84	-	15,683,511.78	-110,661,911.06
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	55,949,464.53	-	-2,896,701.13	53,052,763.40

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：

裴荣荣

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

中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金（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[2022]3055 号文《关于准予中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金注册的批复》，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《中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）等规定公开募集。经向中国证监会备案，于 2023 年 3 月 7 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，基金托管人为南京银行股份有限公司。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 157,629,188.79 份，有效认购户数为 1,495 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息折合基金份额 13,171.49 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。本基金募集资金经天职国际会计师事务所（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《中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括标的指数成份股及备选成份股，为更好实现投资目标，还可以少量投资于国内依法发行上市的其他股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性金融债、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可交换债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券）、债券回购、同业存单、现金等货币市场工具、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、国债期货、股指期货以及法律法规或中国

证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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颁布和修订的《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”）、《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《公开募集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>》、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、《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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

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 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

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、财税明电【2008】2 号《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税征收方式的通知》、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 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【2017】56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税【2017】90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 2027年12月31日前，契约制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，可以选择简易计税方法，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. 2027年12月31日前，对基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的差价收入免征增值税；
4. 2027年12月31日前，存款利息收入不征收增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。
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. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,131,365.29
等于：本金	3,130,923.78
加：应计利息	441.51
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
合计	3,131,365.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	174,200,713.95	—	150,506,355.09	-23,694,358.86
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	174,200,713.95	—	150,506,355.09	-23,694,358.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

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

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期本基金未计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末本基金未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	163.98
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-

其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	26,283.01
合计	26,446.99

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航华证商飞高端制造产业指数发起 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,394,599.68	22,394,599.68
本期申购	129,359,337.17	129,359,337.17
本期赎回（以“-”号填列）	-88,124,098.62	-88,124,098.62
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	63,629,838.23	63,629,838.23

中航华证商飞高端制造产业指数发起 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,927,473.46	22,927,473.46
本期申购	325,953,135.89	325,953,135.89
本期赎回（以“-”号填列）	-234,416,864.43	-234,416,864.43
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	114,463,744.92	114,463,744.92

注：本期申购包含基金红利再投、转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中航华证商飞高端制造产业指数发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,950,334.76	2,318,400.05	368,065.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-1,950,334.76	2,318,400.05	368,065.29
本期利润	-7,571,279.24	-7,921,394.12	-15,492,673.36
本期基金份额交易产生的变动数	-2,217,555.39	11,106,167.27	8,888,611.88
其中：基金申购款	-11,973,140.03	24,218,552.97	12,245,412.94
基金赎回款	9,755,584.64	-13,112,385.70	-3,356,801.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,739,169.39	5,503,173.20	-6,235,996.19

中航华证商飞高端制造产业指数发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,141,148.05	2,353,181.27	212,033.22
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-2,141,148.05	2,353,181.27	212,033.22
本期利润	-14,470,186.49	-18,992,354.81	-33,462,541.30
本期基金份额交易产生的变动数	-5,279,029.49	26,458,281.79	21,179,252.30
其中：基金申购款	-31,713,802.78	63,015,108.55	31,301,305.77
基金赎回款	26,434,773.29	-36,556,826.76	-10,122,053.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,890,364.03	9,819,108.25	-12,071,255.78

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,349.10
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	2,253.71
其他	-
合计	13,602.81

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-22,566,225.75
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	-22,566,225.75
----	----------------

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	379,805,414.24
减：卖出股票成本总额	401,934,312.03
减：交易费用	437,327.96
买卖股票差价收入	-22,566,225.75

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本报告期本基金无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	841,655.73
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	841,655.73

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-26,913,748.93
股票投资	-26,913,748.93
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-26,913,748.93

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	343,735.66
基金转换费收入	15,529.60
合计	359,265.26

6.4.7.22 信用减值损失

本报告期本基金无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	1,487.82
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
合计	26,283.01

6.4.7.24 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、关联关系

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
南京银行股份有限公司	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
中航西安飞机工业集团股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司
中航沈飞股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司
中航光电科技股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司
中航成飞股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司
中航航空科技股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司

中航重机股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司
中航直升机股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司
中航机载系统股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司
江西洪都航空工业股份有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中航证券有限公司	916,350,479.38	100.00	188,369,853.50	100.00

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中航证券有限公司	188,678.69	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中航证券有限公司	38,786.04	100.00	-	-

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取、并由券商承担的费用后的净额列示。②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资

研究成果

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	434,941.01	107,006.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	204,313.49	38,907.40
应支付基金管理人的净管理费	230,627.52	68,099.06

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年实际天数}$$

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，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	86,988.26	21,401.31

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年实际天数}$$

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，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进

行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航华证商飞高端制造产业指数发起 A	中航华证商飞高端制造产业指数发起 C	合计
南京银行股份有限公司	-	129.94	129.94
中航证券有限公司	-	82,589.48	82,589.48
合计	-	82,719.42	82,719.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航华证商飞高端制造产业指数发起 A	中航华证商飞高端制造产业指数发起 C	合计
中航证券有限公司	-	11,100.09	11,100.09
合计	-	11,100.09	11,100.09

注：①计提标准：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：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，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时

支付的，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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	中航华证商飞高端制造产业指数发起 A	中航华证商飞高端制造产业指数发起 C
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	10,000,000.00	—
报告期末持有的基金份额	0.00	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	—
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	中航华证商飞高端制造产业指数发起 A	中航华证商飞高端制造产业指数发起 C
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	—
报告期间申购/买入总份额	—	—

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.87%	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
南京银行股份有限公司	3,131,365.29	11,349.10	2,239,709.83	2,566.75
中航证券有限公司	9,534,219.37	2,253.71	5,731,468.54	2,682.70

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于相关关联方发行的股票：中航成飞（302132）、洪都航空（600316）、中直股份（600038）、中航高科（600862）、中航重机（600765）、中航光电（002179）、中航沈飞（600760）、中航西飞（000768）、中航机载（600372）。

本报告期末，本基金持有中航成飞 136,900 股，占基金资产净值比例 5.00%；本基金持有洪都航空 101,100 股，占基金资产净值比例 1.77%；本基金持有中直股份 195,300 股，占基金资产净值比例 3.09%；本基金持有中航高科 391,100 股，占基金资产净值比例 4.41%；本基金持有中航重机 512,400 股，占基金资产净值比例 4.14%；本基金持有中航光电 296,600 股，占基金资产净值比例 8.58%；本基金持有中航沈飞 265,100 股，占基金资产净值比例 6.82%；本基金持有中航西飞 650,100 股，占基金资产净值比例 8.33%；本基金持有中航机载 566,500 股，占基金资产净值

比例 3.85%。

6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配

6.4.12 期末（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301531	N 春光集	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定受限	13.30	66.90	264	3,511.20	17,661.60	-
301599	N 理奇	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定受限	13.91	40.66	280	3,894.80	11,384.80	-
688808	C 联讯	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定受限	81.88	2,086.66	56	4,585.28	116,852.96	-

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因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。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在严格控制风险的前提下，谋求实现基金资产的长期稳定增长的投资目标。

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。从定性分析的角度出发，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。

基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。基金的货币资金存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该货币资金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，违约风险事件发生的可能性很小；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，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。

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

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(若有)将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中

度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金的基金管理人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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,131,365.29	-	-	-	3,131,365.29
结算备付金	9,561,197.97	-	-	-	9,561,197.97
交易性金融资产	-	-	-	150,506,355.09	150,506,355.09
应收申购款	-	-	-	565,713.78	565,713.78
资产总计	12,692,563.26	-	-	151,072,068.87	163,764,632.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,844,525.55	3,844,525.55
应付管理人报酬	-	-	-	70,400.41	70,400.41
应付托管费	-	-	-	14,080.09	14,080.09
应付销售服务费	-	-	-	22,847.91	22,847.91
其他负债	-	-	-	26,446.99	26,446.99
负债总计	-	-	-	3,978,300.95	3,978,300.95
利率敏感度缺口	12,692,563.26	-	-	147,093,767.92	159,786,331.18
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,215,314.59	-	-	-	3,215,314.59
结算备付金	1,894,267.39	-	-	-	1,894,267.39
交易性金融资产	-	-	-	42,689,901.43	42,689,901.43
应收申购款	-	-	-	898,639.93	898,639.93
资产总计	5,109,581.98	-	-	43,588,541.36	48,698,123.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,765,499.88	2,765,499.88
应付管理人报酬	-	-	-	18,710.28	18,710.28
应付托管费	-	-	-	3,742.06	3,742.06
应付销售服务费	-	-	-	4,888.52	4,888.52
其他负债	-	-	-	3,110.95	3,110.95
负债总计	-	-	-	2,795,951.69	2,795,951.69
利率敏感度缺口	5,109,581.98	-	-	40,792,589.67	45,902,171.65

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资或资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	150,506,355.09	94.19	42,689,901.43	93.00
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	150,506,355.09	94.19	42,689,901.43	93.00

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	7,482,303.45	2,155,686.62
	业绩比较基准下降	-7,482,303.45	-2,155,686.62

	5%		
--	----	--	--

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 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	150,360,455.73	41,491,989.43
第二层次	—	1,197,912.00
第三层次	145,899.36	—
合计	150,506,355.09	42,689,901.43

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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	权益投资	150,506,355.09	91.90
	其中：股票	150,506,355.09	91.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,692,563.26	7.75
8	其他各项资产	565,713.78	0.35
9	合计	163,764,632.13	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	147,524,432.49	92.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	403,015.60	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,465,707.00	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,113,200.00	0.70

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	150,506,355.09	94.19

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资的股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002179	中航光电	296,600	13,702,920.00	8.58
2	000768	中航西飞	650,100	13,314,048.00	8.33
3	600893	航发动力	312,200	11,969,748.00	7.49
4	600760	中航沈飞	265,100	10,895,610.00	6.82
5	302132	中航成飞	136,900	7,984,008.00	5.00
6	600862	中航高科	391,100	7,051,533.00	4.41
7	600765	中航重机	512,400	6,620,208.00	4.14
8	688122	西部超导	104,949	6,591,846.69	4.13
9	600372	中航机载	566,500	6,146,525.00	3.85
10	000988	华工科技	28,900	5,335,229.00	3.34
11	600038	中直股份	195,300	4,939,137.00	3.09
12	300395	菲利华	36,600	4,894,518.00	3.06
13	300699	光威复材	138,200	3,959,430.00	2.48
14	300775	三角防务	179,100	3,947,364.00	2.47
15	600391	航发科技	104,100	3,482,145.00	2.18
16	688563	航材股份	62,682	3,211,198.86	2.01

17	600316	洪都航空	101,100	2,824,734.00	1.77
18	000738	航发控制	153,900	2,814,831.00	1.76
19	600399	抚顺特钢	654,900	2,691,639.00	1.68
20	002049	紫光国微	29,340	2,603,925.00	1.63
21	603308	应流股份	35,800	2,162,320.00	1.35
22	600118	中国卫星	25,400	2,084,070.00	1.30
23	688239	航宇科技	34,196	2,045,946.68	1.28
24	600456	宝钛股份	68,300	1,868,005.00	1.17
25	300696	爱乐达	70,800	1,842,924.00	1.15
26	300424	航新科技	111,000	1,747,140.00	1.09
27	600378	昊华科技	21,600	1,628,208.00	1.02
28	002297	博云新材	55,200	1,600,248.00	1.00
29	600115	中国东航	384,700	1,465,707.00	0.92
30	600219	南山铝业	319,100	1,273,209.00	0.80
31	601698	中国卫通	36,800	1,113,200.00	0.70
32	002414	高德红外	76,200	1,010,412.00	0.63
33	002023	海特高新	72,200	935,712.00	0.59
34	000801	四川九洲	68,000	879,920.00	0.55
35	002130	沃尔核材	46,300	877,848.00	0.55
36	002985	北摩高科	24,600	681,420.00	0.43
37	688510	航亚科技	26,160	624,700.80	0.39
38	688685	迈信林	10,429	572,552.10	0.36
39	688523	航天环宇	10,750	563,300.00	0.35
40	001316	润贝航科	12,220	403,015.60	0.25
41	688808	C 联讯	56	116,852.96	0.07
42	301531	N 春光集	264	17,661.60	0.01
43	301599	N 理奇	280	11,384.80	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本报告期末本基金未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000768	中航西飞	49,014,785.00	106.78
2	600760	中航沈飞	36,862,294.19	80.31
3	002179	中航光电	32,509,032.00	70.82
4	600893	航发动力	30,008,377.00	65.37
5	600862	中航高科	29,376,874.00	64.00
6	600765	中航重机	29,113,636.00	63.43
7	302132	中航成飞	28,014,094.88	61.03
8	600372	中航机载	25,415,249.06	55.37

9	300775	三角防务	18,453,758.82	40.20
10	688122	西部超导	17,137,769.22	37.34
11	600391	航发科技	16,316,941.00	35.55
12	300699	光威复材	14,890,982.00	32.44
13	000988	华工科技	14,446,804.00	31.47
14	600038	中直股份	14,283,159.00	31.12
15	600399	抚顺特钢	13,905,574.00	30.29
16	600316	洪都航空	12,080,926.00	26.32
17	688563	航材股份	11,978,856.49	26.10
18	000738	航发控制	11,829,156.00	25.77
19	300777	中简科技	11,373,249.00	24.78
20	688568	中科星图	10,072,504.01	21.94
21	002049	紫光国微	9,633,579.60	20.99
22	600219	南山铝业	9,012,506.00	19.63
23	600456	宝钛股份	8,013,643.00	17.46
24	300696	爱乐达	7,613,614.00	16.59
25	600118	中国卫星	6,352,169.76	13.84
26	688281	华秦科技	6,262,518.76	13.64
27	300424	航新科技	6,043,168.00	13.17
28	300395	菲利华	5,797,177.80	12.63
29	601698	中国卫通	5,744,981.00	12.52
30	002130	沃尔核材	5,650,363.00	12.31
31	002414	高德红外	4,957,228.00	10.80
32	688239	航宇科技	4,338,899.84	9.45
33	600378	昊华科技	3,524,876.00	7.68
34	000801	四川九洲	3,139,149.00	6.84
35	002297	博云新材	2,941,104.82	6.41
36	002023	海特高新	2,821,142.00	6.15
37	603308	应流股份	2,753,125.00	6.00
38	002985	北摩高科	2,577,441.00	5.62
39	688510	航亚科技	2,341,183.37	5.10
40	603809	豪能股份	1,865,162.38	4.06
41	600115	中国东航	1,850,139.00	4.03
42	688685	迈信林	1,840,408.09	4.01
43	001316	润贝航科	1,421,250.00	3.10
44	300553	集智股份	1,276,321.00	2.78

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	000768	中航西飞	33,063,718.00	72.03
2	002179	中航光电	25,029,387.00	54.53
3	600760	中航沈飞	24,217,421.00	52.76
4	600862	中航高科	20,328,418.12	44.29
5	600765	中航重机	20,141,047.20	43.88
6	302132	中航成飞	19,268,400.00	41.98
7	600372	中航机载	17,848,798.00	38.88
8	600893	航发动力	16,856,015.00	36.72
9	300775	三角防务	12,883,343.00	28.07
10	000988	华工科技	12,090,625.00	26.34
11	600391	航发科技	11,914,692.00	25.96
12	300777	中简科技	11,281,138.00	24.58
13	300699	光威复材	10,679,251.44	23.27
14	600399	抚顺特钢	9,637,099.00	20.99
15	688568	中科星图	9,460,342.90	20.61
16	688122	西部超导	9,429,104.05	20.54
17	600316	洪都航空	8,643,499.00	18.83
18	000738	航发控制	8,522,090.00	18.57
19	688563	航材股份	8,443,462.26	18.39
20	600038	中直股份	8,306,797.00	18.10
21	002049	紫光国微	8,202,964.20	17.87
22	600219	南山铝业	7,767,146.00	16.92
23	688281	华秦科技	6,457,324.18	14.07
24	300696	爱乐达	5,802,992.40	12.64
25	600456	宝钛股份	5,545,034.00	12.08
26	601698	中国卫通	4,784,154.00	10.42
27	002130	沃尔核材	4,713,478.00	10.27
28	300424	航新科技	4,430,738.00	9.65
29	002414	高德红外	4,086,497.00	8.90
30	600118	中国卫星	3,921,793.00	8.54
31	600378	昊华科技	3,379,474.00	7.36
32	002297	博云新材	2,438,652.00	5.31
33	688239	航宇科技	2,387,382.05	5.20
34	000801	四川九洲	2,224,342.00	4.85
35	002023	海特高新	2,111,343.00	4.60
36	603809	豪能股份	2,077,137.00	4.53
37	002985	北摩高科	1,814,571.00	3.95
38	300553	集智股份	1,647,970.00	3.59
39	688510	航亚科技	1,546,379.83	3.37
40	688685	迈信林	1,438,935.50	3.13
41	001316	润贝航科	1,179,563.60	2.57
42	300395	菲利华	1,084,602.00	2.36

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	536,664,514.62
卖出股票收入（成交）总额	379,805,414.24

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

西部超导（代码：688122）

2025 年 8 月 26 日，陕西证监局因公司存在收入核算不规范、募集资金存放与使用不规范、

2024 年年报前五大客户明细金额披露不准确问题，对西部超导采取责令改正行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。

本基金投资西部超导的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金除西部超导外，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，或者存在报告编制日前一年内收到公开谴责和处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同约定股票库之内的股票。

7.12.3 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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	565,713.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	565,713.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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

份额级别	持有人 户数	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
中航华证 商飞高端 制造产业 指数发起 A	6,580	9,670.19	11,076,175.87	17.41	52,553,662.36	82.59
中航华证 商飞高端 制造产业 指数发起 C	6,783	16,875.09	596,201.34	0.52	113,867,543.58	99.48
合计	13,134	13,559.74	11,672,377.21	6.55	166,421,205.94	93.45

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中航华证商飞高端制造产业指 数发起 A	227,483.20	0.36
	中航华证商飞高端制造产业指 数发起 C	43.77	—
	合计	227,526.97	0.13

8.3 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情况

本报告期末本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金的发起资金持有份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航华证商飞高端制造产业指数发 起 A	中航华证商飞高端制造产业指数发 起 C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 7 日) 基金份额总额	35,955,938.39	121,673,250.40
本报告期期初基金份 额总额	22,394,599.68	22,927,473.46
本报告期基金总申购	129,359,337.17	325,953,135.89

份额		
减：本报告期基金总赎回份额	88,124,098.62	234,416,864.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	63,629,838.23	114,463,744.92

注：基金总申购份额包含基金红利再投、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

本报告期内未召开持有人大会。

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. 2026 年 4 月，朱群力同志不再担任南京银行股份有限公司资产托管部总经理职务，由王艳同志接任南京银行股份有限公司资产托管部总经理职务。
2. 2026 年 2 月 4 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》。自 2026 年 2 月 2 日起，宋鑫担任公司督察长职务，刘建不再担任公司督察长职务。
3. 2026 年 4 月 24 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》。自 2026 年 4 月 22 日起，王楠担任公司副总经理职务。

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

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受到调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门未出现受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的相关从业人员未出现受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
中航证券有限公司	2	916,350,479.38	100.00	188,678.69	100.00	-

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式。

2、此处的佣金指本基金通过证券公司的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该证券公司的佣金合计，不单指股票交易佣金。

3、交易单元的选择标准和程序

选择标准：①实力雄厚，信誉良好；②研究、交易实力较强，选择需要支付研究服务费用的证券公司，应考察其研究服务能力，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；③财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；④经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，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要求，并能为基金提供全面的信息服务。

选择程序：①对合作证券公司研究机构实行评分制；②研究部根据证券公司研究机构的评分结果及交易单元租用协议的谈判结果向投资决策委员会申请开通交易单元或调整佣金；③中央交易室根据投资决策委员会决议与证券公司签订交易单元租用协议或券结协议。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)

中航证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
------------------	---	---	---	---	---	---

10.8 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	中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 22 日
2	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 4 日
3	中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金更新的招募说明书（2026 年第 1 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 7 日
4	中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资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	2026 年 2 月 7 日
5	中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
6	中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 22 日
7	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 24 日
8	中航基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司销售业务的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 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	20260101-20260107	10,000,000.00	-	10,000,000.00	-	0.00
产品特有风险							
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。

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

1. 中国证监会批准中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金募集的文件
2. 《中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照
5. 报告期内中航华证商飞高端制造产业主题指数型发起式证券投资基金在规定媒体上披露的各项公告

12.2 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 号院亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801\805\806 单元。

12.3 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

2026 年 8 月 29 日