

中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证
券投资基金
2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 月 31 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 4 月 21 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 月 20 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 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	014428
交易代码	014428
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 13 日
报告期末基金份额总额	1,619,187,043.16 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>1、优化抽样复制策略：本基金通过对标的指数中各成份券的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的成份券构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟</p>

	<p>踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>2、替代性策略：对于市场流动性不足、因法律法规原因个别成份券被限制投资等情况，本基金无法获得对个别成份券足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份券、非成份券等方式进行替代。</p> <p>3、债券投资策略。</p> <p>4、资产支持证券投资策略。</p> <p>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定并履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率*95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	中航基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 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（2022年1月1日—2022年3月31日）
1. 本期已实现收益	5,235,090.04
2. 本期利润	5,251,966.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0049
4. 期末基金资产净值	1,630,449,851.51
5. 期末基金份额净值	1.0070

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所述基金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。

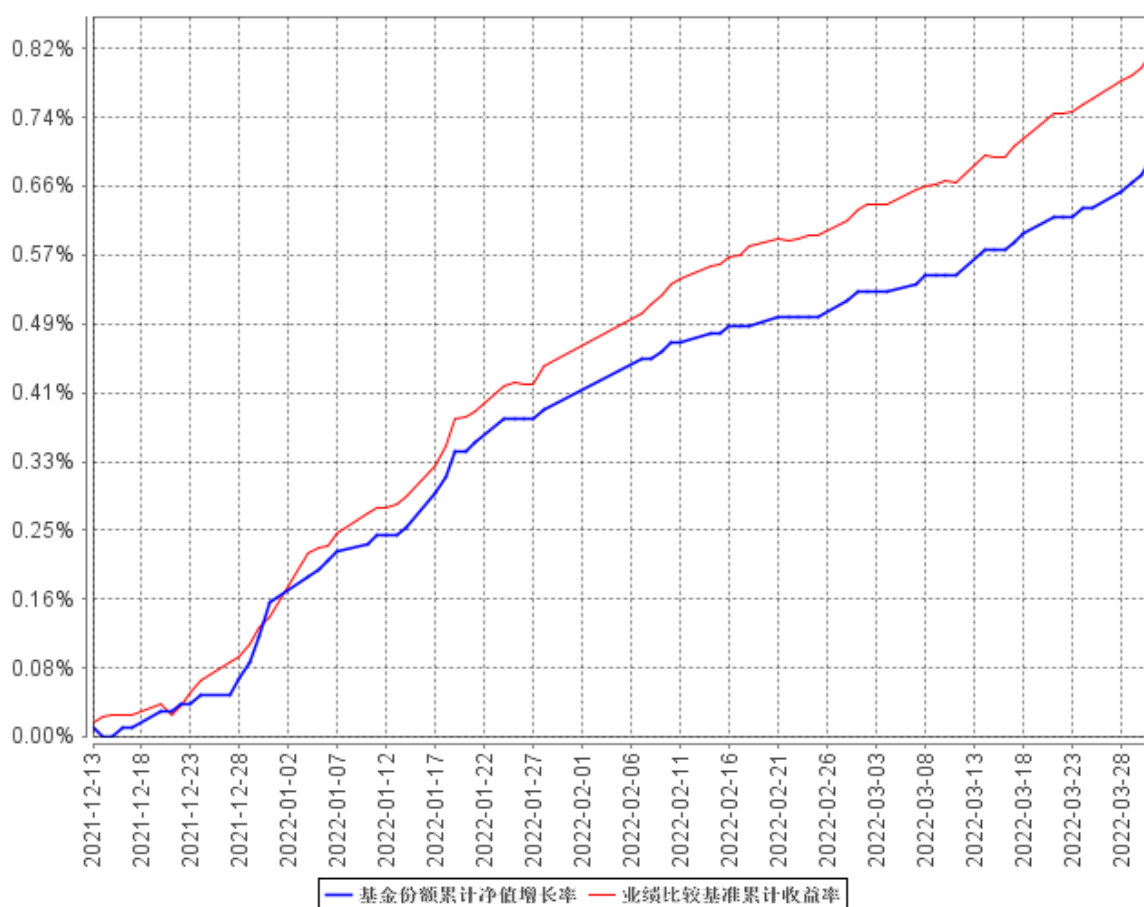
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率 ①	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	0.53%	0.01%	0.67%	0.01%	-0.14%	0.00%
自基金合同 生效起至今	0.70%	0.01%	0.80%	0.01%	-0.10%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

基金份额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	2021 年 12 月 13 日	-	4	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责任公司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》、《中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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，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

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年一季度，国内宏观经济形势较 2021 年四季度好转，但经济发展依然面临着需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力。从内部看，国内疫情发生频次有所增多，扰乱经济复苏节奏，房地产行业投融资寒冬尚未过去，地方政府发力稳增长的热情有待激发；从外部看，国外疫情持续，地缘政治冲突升级，全球大宗商品价格暴涨，海外央行掀起加息潮，外部环境更趋复杂严峻和不确定。货币政策和财政政策坚持稳字当头、稳中求进，发力稳增长、宽信用。一季度受国内外复杂的政治经济环境影响，国内金融市场出现较大幅度波动。从债券市场走势来看：年初在央行宽松货币政策和经济悲观预期影响下，债市收益率下行；随着市场预期好转、1 月份 PMI 超预期、金融数据“开门红”，债市收益率转而上行；2 月份金融数据不及预期，宽信用遭遇挫折，市场降准降息预期再起，债市收益率掉头下行；1-2 月份经济数据大超预期后，债市收益率再度上行；此后国内部分地区疫情出现反复，经济悲观预期再次升温，债市收益率转而下行。期间，欧美央行加息、俄乌冲突、全球通胀等因素也对国内债市频频造成扰动。一季度，本基金把控制风险放在投资管理的重要位置，以指数样本券为主要投资标的，适度配置高等级信用债，在保持组合较高流动性的同时，尽可能降低跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金份额净值为 1.0070，本报告期基金份额净值增长率为 0.53%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%。

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,372,063,149.40	63.13
	其中：债券	1,372,063,149.40	63.13
	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	600,593,182.56	27.64
	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	821,422.70	0.04
8	其他资产	199,792,067.60	9.19
9	合计	2,173,269,822.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（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	113,299,917.81	6.95
	其中：政策性金融债	113,299,917.81	6.95
4	企业债券	20,836,657.53	1.28
5	企业短期融资券	221,188,684.94	13.57
6	中期票据	51,819,901.37	3.18
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	964,917,987.75	59.18
9	其他	-	-
10	合计	1,372,063,149.40	84.15

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112210017	22 兴业银行 CD017	1,000,000	98,043,563.84	6.01
2	012103977	21 联合水泥 SCP004	700,000	70,781,928.77	4.34
3	012280681	22 杭州钢铁 SCP002	700,000	69,987,227.40	4.29
4	112107083	21 招商银行 CD083	700,000	69,495,869.59	4.26
5	112211004	22 平安银行 CD004	700,000	68,648,080.60	4.21

5.6 报告期末按公允价值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。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

22 兴业银行 CD017（代码：112210017）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报贷款核销业务 EAST 数据；漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；漏报权益类投资业务 EAST 数据；漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；未报送跟单信用证业务 EAST 数据；漏报贷款承诺业务 EAST 数据；未报送委托贷款业务 EAST 数据；EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；漏报分户账 EAST 数据；EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报，罚款 350 万元。

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。

22 平安银行 CD004（代码：112211004）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对平安银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报抵押物价值 EAST 数据；未报送权益类投资业务 EAST 数据；漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；漏报委托贷款业务 EAST 数据；EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；漏报分户账 EAST 数据；EAST 系统《表外授信业务》表错报；EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；EAST 系统《关联关系》表漏报；EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报，罚款 400 万元。

2021 年 9 月 29 日，国家外汇管理局深圳市分局对平安银行违规办理转口贸易收付汇；违规办理个人财产对外转移；违规办理个人结售汇业务；违规为境外个人购买境内理财产品；未按规定进行国际收支统计申报；未按照规定报送财务会计报告、统计报告的等资料；违反外汇登记管

理规定；违规开展外汇市场交易，决定责令改正、给予警告，处罚款人民币 187 万元，没收违法所得 1.58 万元。

2021 年 5 月 28 日，中国银保监会云南监管局对平安银行利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资；流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单；固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品，罚款人民币 210 万元。

21 招商银行 CD083（代码：112107083）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对招商银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；漏报贷款核销业务 EAST 数据；漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；未报送权益类投资业务 EAST 数据；未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；漏报贷款承诺业务 EAST 数据；漏报委托贷款业务 EAST 数据；EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；EAST 系统分户账与总账比对不一致；漏报分户账 EAST 数据；EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报，罚款 300 万元。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对招商银行为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位；理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；同业投资接受第三方金融机构信用担保；理财资金池化运作；利用理财产品准备金调节收益；高净值客户认定不审慎；并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；投资集合资金信托计划人数超限；面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；信贷资产非真实转让；全权委托业务不规范；未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；票据转贴现假卖断屡查屡犯；贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；理财资金

认购商业银行增发的股票；违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承销债券以承接表内类信贷资产；为定制公募基金提供投资顾问；为本行承销债券兑付提供资金支持；协助发行人以非市场化的价格发行债券；瞒报案件信息，罚款 7170 万元。

20 进出 02（代码：200302）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对中国进出口银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：漏报不良贷款余额 EAST 数据；漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报贷款核销业务 EAST 数据；漏报抵押物价值 EAST 数据；漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；漏报债券投资业务 EAST 数据；漏报权益类投资业务 EAST 数据；漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；漏报跟单信用证业务 EAST 数据；漏报贷款承诺业务 EAST 数据；未报送委托贷款业务 EAST 数据；EAST 系统分户账与总账比对不一致；漏报分户账 EAST 数据；EAST 系统《对公活期存款分户账明细记录》表错报；EAST 系统《关联关系》表漏报；EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报，罚款 420 万元。

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。

15 国开 09（代码：150209）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对国家开发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报贷款核销业务 EAST 数据；信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差；未报送债券投资业务 EAST 数据；漏报权益类投资业务 EAST 数据；漏报跟单信用证业务 EAST 数据；漏报保函业务 EAST 数据；EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；EAST 系统理财产品非

标投向行业余额数据存在偏差；漏报分户账 EAST 数据；漏报授信信息 EAST 数据；EAST 系统《表外授信业务》表错报；EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；EAST 系统《关联关系》表漏报；EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；理财产品登记不规范，罚款 440 万元。

21 渤海银行 CD472（代码：112121472）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对渤海银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报贷款核销业务 EAST 数据；漏报抵押物价值 EAST 数据；未报送信贷资产转让业务 EAST 数据；漏报债券投资业务 EAST 数据；公募基金投资业务 EAST 数据存在偏差；EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；EAST 系统分户账与总账比对不一致；漏报总账或分户账 EAST 数据；漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；EAST 系统《表外授信业务》表错报；EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；未报送本行理财产品间相互交易记录，罚款 360 万元。

2021 年 10 月 22 日，国家外汇管理局天津市分局对渤海银行办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等违法违规事项，责令改正，给予警告，处罚款 1856 万元，没收违法所得 175.39 万元，罚没款合计 2031.39 万元。

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。

22 建设银行 CD009（代码：112205009）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对建设银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：贸易融资业务 EAST 数据存在偏差；贷款核销业务 EAST 数据存在偏差；漏报抵押物价值 EAST 数据；漏报债券投资业务 EAST 数据；未报送权益类投资业务 EAST 数据；漏报公募基金投资业务 EAST 数据；未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；未报送跟单信用证业务 EAST 数据；漏报保函业务 EAST 数据；未报送其他担保类业务 EAST 数据；漏报委托贷款业务 EAST 数据；EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；EAST 系统《表外授信业务》表错报；EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；EAST 系统《关联关系》表漏报；2018 年行政处罚问题依然存在，罚款 470 万元。

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行对建设银行占压财政存款或者资金；违反账户管理规定，警告并处罚款 388 万元。

本基金投资 22 兴业银行 CD017、22 平安银行 CD004、21 招商银行 CD083、20 进出 02、15 国开 09、21 渤海银行 CD472、22 建设银行 CD009 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金除 22 兴业银行 CD017、22 平安银行 CD004、21 招商银行 CD083、20 进出 02、15 国开 09、21 渤海银行 CD472、22 建设银行 CD009 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

无。

5.11.3 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	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	199,713,291.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	78,775.89

8	其他	-
9	合计	199,792,067.60

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	643,547,727.44
报告期期间基金总申购份额	6,064,649,903.51
减：报告期期间基金总赎回份额	5,089,010,587.79
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,619,187,043.16

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金募集的文件
2. 《中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》
3. 《中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照
5. 报告期内中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金在规定媒体上披露的各项公告

8.2 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 号北京亚洲金融大厦 B 座 1001、1007、1008 单元

8.3 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

2022 年 4 月 21 日