

中航航行宝货币市场基金 2022 年中期报告

2022 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

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 债券回购融资情况.....	46
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	46
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细....	48
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	48
7.8 期末按实际利率计算账面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.....	49
7.9 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.4 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的情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	57
10.9 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中航航空宝货币市场基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	152,787,635.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中航航空宝 A	中航航空宝 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	10,181,419.11 份	142,606,216.32 份

注：本基金 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续。

2.2 基金产品说明

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 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 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</p>

	<p>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。

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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武国强	帅芳
	联系电话	010-56716188	021-38031815
	电子邮箱	wuguoqiang@avicfund.cn	shuaifang@gtjas.com
客户服务电话		400-666-2186	021-38917599-5
传真		010-56716198	021-38677819
注册地址		北京市朝阳区天辰东路1号院1号楼1层101内10层B1001号	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		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	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		100101	200041
法定代表人		杨彦伟	贺青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金中期报告备置地点	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号北京亚洲金融大厦 B座 1001、1007、1008 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

基金级别	中航航空宝 A	中航航空宝 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)	报告期(2022年6月24日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	1,678,542.03	58,675.61
本期利润	1,678,542.03	58,675.61
本期净值收益率	0.8668%	0.0412%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末基金资产净值	10,181,419.11	142,606,216.32
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
累计净值收益率	14.4367%	0.0412%

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，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本基金每日分配收益，按日结转份额。

④本基金 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续。

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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.1202%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.0092%	0.0011%
过去三个月	0.4176%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.0810%	0.0020%
过去六个月	0.8668%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	0.1973%	0.0015%
过去一年	1.8165%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	0.4665%	0.0011%
过去三年	5.8467%	0.0014%	4.0537%	0.0000%	1.7930%	0.0014%
过去五年	12.7431%	0.0034%	6.7537%	0.0000%	5.9894%	0.0034%
自基金合同生效起至今	14.4367%	0.0034%	7.3344%	0.0000%	7.1023%	0.0034%

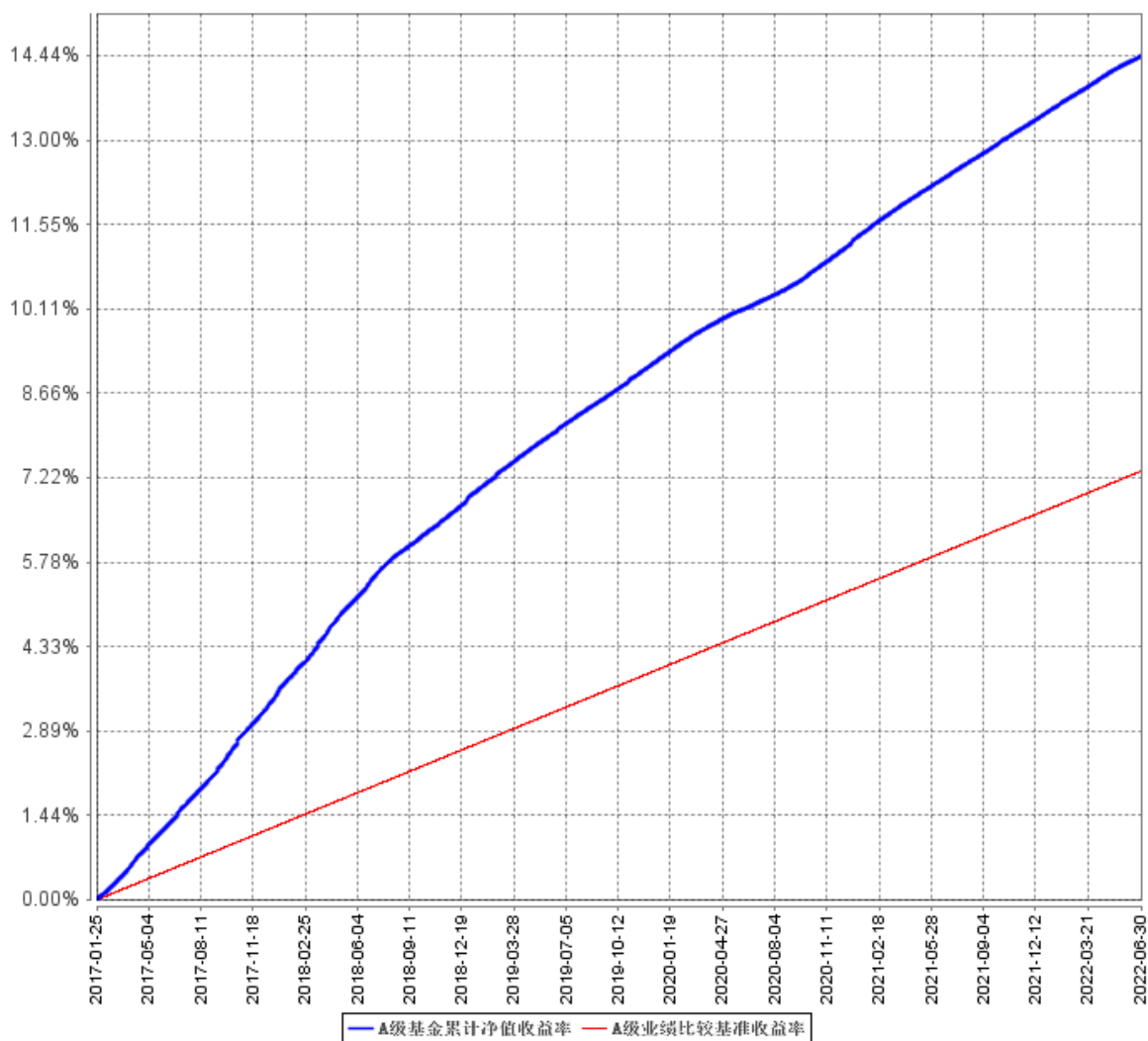
中航航空宝 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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
自基金合同 生效起至今	0.0412%	0.0025%	0.0259%	0.0000%	0.0153%	0.0025%

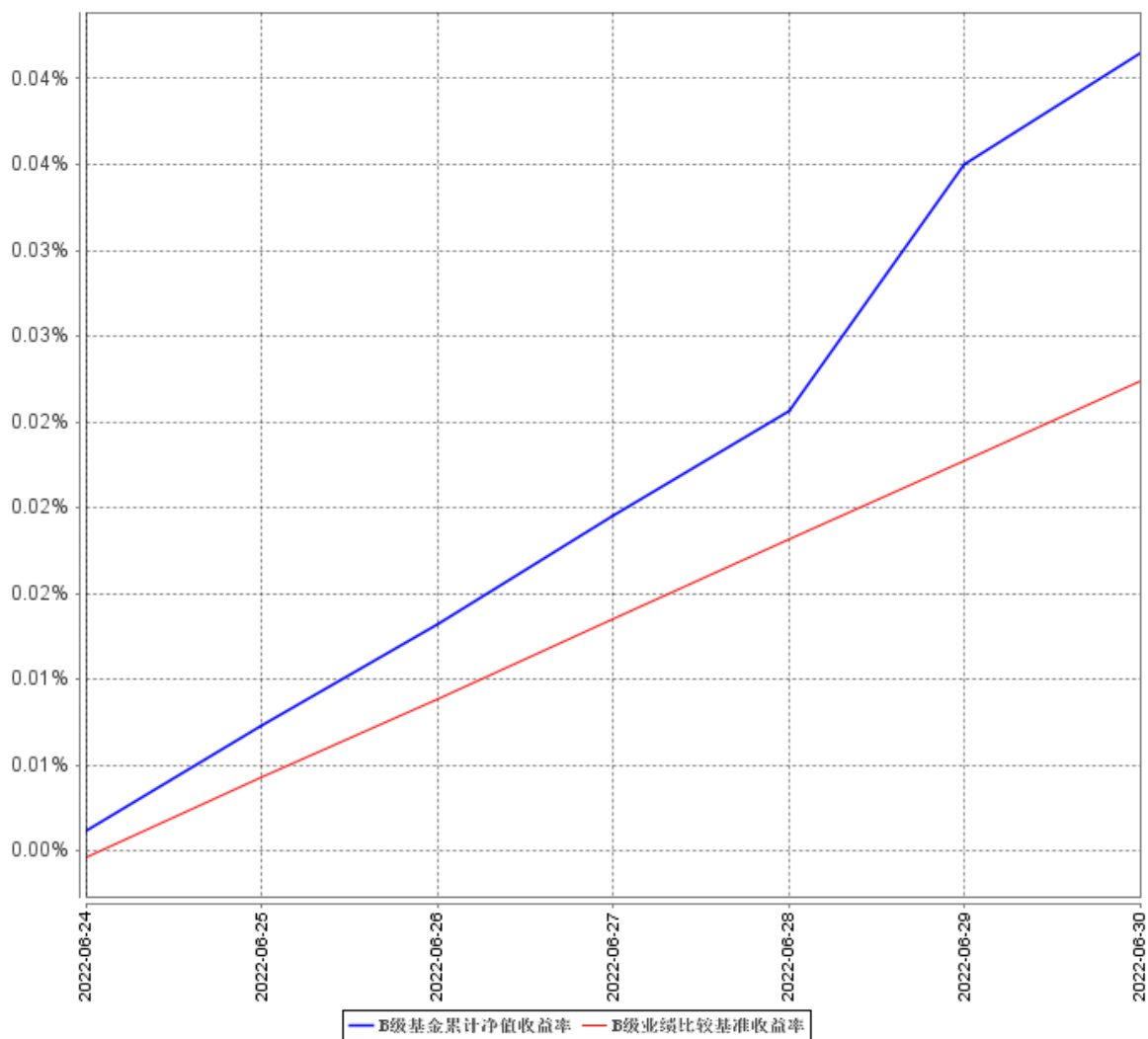
注：本基金 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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		
茅勇峰	基金经理	2018 年 6 月 15 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公司固定收益部基金经理。
李祥源	基金经理	2022 年 5 月 23 日	-	7	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《证券业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》、《中航航空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 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

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。同时，加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

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不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

本基金本报告期内不存在异常交易行为。未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。且不存在所有投资组合参与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的 5% 的情形。

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

2022 年上半年，债市的主要矛盾聚焦在疫情与资金面的博弈，对经济的看法相对一致，债券收益率整体维持震荡，但期限有所分化，收益率曲线愈发陡峭。上半年经济数据受疫情因素影响较大，制造业和服务业 PMI 数据维持低迷，难以快速走出阵痛，地方债发行前置发力，基建仍是经济逆周期调节中重要的一环，但地产受融资环境叠加疫情因素的影响在上半年对经济有所拖累。上半年央行开展了降息降准操作，货币市场操作稳健，此外央行上缴利润对市场进行了货币投放，货币政策仍是稳中有松，给与市场充分预期管理，地方债的缴款对市场资金面影响很小。上半年信用债市场的不稳定因素来自于地产行业，抛压极易引起恐慌的连锁反应，中高等级产业债和城投债表现稳健，民企信用债分化更为明显。上半年海外疫情对经济的边际影响已经减弱，美国经济面临高通胀压力，但市场对加息预期已经反应的比较充分，经济韧性仍在，欧洲经济仍没有复苏的迹象。上半年债市整体表现尚可，信用债表现优于利率债，“以我为主”的货币政策进一步证实，市场多头占据主导。上半年资金市场较为宽松，货币类资产表现较好，同业存单供需两旺，

市场对短久期防御属性强的资产较为偏爱。

本组合在报告期内仍主要投资于同业存单等流动性较好的资产，适当拉长组合期限以增厚组合收益，杠杆水平较低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内中航航空宝 A 的基金份额净值收益率为 0.8668%，业绩比较基准收益率为 0.6695%；本报告期内中航航空宝 B 的基金份额净值收益率为 0.0412%（中航航空宝 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续），同期业绩比较基准收益率为 0.0259%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在“以我为主”的货币政策基调下，海外经济和通胀预期对国内政策扰动有限，虽然财政政策仍在发力，短期内经济快速企稳仍是空中楼阁，地产风险仍在继续暴露，国内稳健的货币政策是债市一支有力的强心针，但我们仍要关注较低资金利率的可持续性以及监管对高杠杆的容忍性。

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

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金 A 级应分配且已分配利润 1,678,542.03 元，B 级应分配且已分配利润 58,675.61 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

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

报告期内未出现管理人对基金持有人数或基金资产净值预警情形。

§ 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在中航航空宝货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 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：中航航空宝货币市场基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,256,284.41	7,319,298.20
结算备付金		-	-
存出保证金		1,388.62	-
交易性金融资产	6.4.7.2	149,647,027.58	199,288,825.88
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		149,647,027.58	199,288,825.88
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	-	25,000,357.50
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		60,300.00	10,100.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	557,316.24
资产总计		152,965,000.61	232,175,897.82
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付管理人报酬		47,437.34	66,431.10
应付托管费		13,146.14	16,104.49
应付销售服务费		21,367.92	30,195.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,127.34	1,241.02
应付利润		7,883.89	12,852.79
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	86,402.55	161,865.53
负债合计		177,365.18	288,690.91
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	152,787,635.43	231,887,206.91
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		152,787,635.43	231,887,206.91
负债和净资产总计		152,965,000.61	232,175,897.82

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 152,787,635.43 份，基金份额净值 1.0000 元，其中中航航空宝 A 基金份额总额 10,181,419.11 份，中航航空宝 B 基金份额总额 142,606,216.32 份；

②本基金 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续。

③以上比较财务信息已根据最新的《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：中航航空宝货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,377,427.84	3,773,829.34
1.利息收入		524,327.44	3,770,830.36
其中：存款利息收入	6.4.7.13	65,564.96	48,480.08
债券利息收入		-	2,858,814.97

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		458,762.48	863,535.31
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,853,100.40	2,998.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,853,100.40	2,998.98
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	-	-
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	-	-
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	-	-
减：二、营业总支出		640,210.20	908,524.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	321,060.61	479,492.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	79,479.12	116,240.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	145,742.15	217,951.40
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,405.78	5,462.33
其中：卖出回购金融资产支出		3,405.78	5,462.33
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		810.36	359.68
8. 其他费用	6.4.7.23	89,712.18	89,017.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,737,217.64	2,865,305.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,737,217.64	2,865,305.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,737,217.64	2,865,305.22

注：以上比较财务信息已根据最新的《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中航航空宝货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	231,887,206.91	-	-	231,887,206.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	231,887,206.91	-	-	231,887,206.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-79,099,571.48	-	-	-79,099,571.48
（一）、综合收益总额	-	-	1,737,217.64	1,737,217.64
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-79,099,571.48	-	-	-79,099,571.48
其中：1.基金申购款	224,262,712.51	-	-	224,262,712.51
2.基金赎回款	-303,362,283.99	-	-	-303,362,283.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-1,737,217.64	-1,737,217.64
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	152,787,635.43	-	-	152,787,635.43
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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（基金净值）	211,395,242.68	-	-	211,395,242.68
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基	211,395,242.68	-	-	211,395,242.68

金净值)				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	197,172,377.59	-	-	197,172,377.59
（一）、综合收益总额	-	-	2,865,305.22	2,865,305.22
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	197,172,377.59	-	-	197,172,377.59
其中：1.基金申购款	369,660,130.55	-	-	369,660,130.55
2.基金赎回款	-172,487,752.96	-	-	-172,487,752.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-2,865,305.22	-2,865,305.22
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	408,567,620.27	-	-	408,567,620.27

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：

_____ 刘建 _____	_____ 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

中航航行宝货币市场基金（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[2016]3041 号文《关于准予中航航行宝货币市场基金注册的批复》，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《中航航行宝货币市场基金基金合同》（“基金合同”）等规定公开募集。经向中国证监会备案，于 2017 年 1 月 25 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，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。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 520,655,938.43 份，有效认购户数为 324 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息折合基金份额 29,850.43 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。本基金募集资金经中喜会计师事务所（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《中航航行宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行

票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，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 2006 年 2 月 15 日颁布的《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”）、中国基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号—半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度和中期报告》、《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。

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

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与最近一期年度报告不一致，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

基金目前以交易目的持有的债券投资、资产支持证券投资等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和、资产支持证券、同业存单投资等按票面利率或商定利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）每日计提应计利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和、资产支持证券、同业存单投资等的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。

金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金计价采用摊余成本法，估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其收益期限内摊销，每日计提收益或损失。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按估值技术计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生不利影响，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的计价对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与采用影子定价计算的净值产生重大偏离时，基金管理人与基金托管人商定后按影子定价确定的公允价对其账面价值进行调整，并按影子定价进行后续计量，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。如基金份额净值恢复至 1.0000 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。

计算影子价格时按如下原则确定投资品种的公允价值：

(1) 对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资、资产支持证券、同业存单投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发

行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资、资产支持证券、同业存单投资等处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费 在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

- 1、本基金每份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- 3、每日收益分配：本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
- 4、本基金基金份额根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。在进行收益支付时，若基金已实现收益大于零，则增加基金份额持有人基金份额；若基金已实现收益等于零时，则保持基金份额持有人基金份额不变；若基金已实现收益小于零时，缩减基金份额持有人基金份额；
- 5、当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；
- 6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.11 分部报告

无。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

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 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产科目及账面价值：银行存款金额 7,319,298.20 元、买入返售金融资产金额 25,000,357.50 元、应收利息金额 557,316.24 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产科目及账面价值调整为：银行存款金额 7,323,064.56 元、买入返售金融资产金额 25,019,244.36 元、应收利息金额 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产科目及账面价值：交易性金融资产金额 199,288,825.88 元，新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产科目及账面价值调整为：交易性金融资产金额 199,823,488.90 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债科目及账面价值：应付交易费用金额 9,865.53 元、其他负债金额 152,000.00 元。新金融工具准则下金融负债科目及账面价值调整为：应付交易费用金额 0.00 元、其他负债金额 161,865.53 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的

计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 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

根据财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税【2016】36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税【2016】46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税【2016】70 号《关于金融机构 同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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，暂适用简易计税方法，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. 基金买卖债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税；
4. 存款利息收入不征收增值税；
5. 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税；
6. 对基金取得的企业债券利息收入，由各兑付机构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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	3,256,284.41
等于：本金	3,249,401.84
加：应计利息	6,882.57
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
减：坏账准备	-
合计：	3,256,284.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	149,647,027.58	149,826,768.22	179,740.64	0.1176%
	合计	149,647,027.58	149,826,768.22	179,740.64	0.1176%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	149,647,027.58	149,826,768.22	179,740.64	0.1176%

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。

6.4.7.8 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 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,490.37
其中：交易所市场	6,490.37
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	79,912.18
合计	86,402.55

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和银行间账户维护费。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航航空宝 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	231,887,206.91	231,887,206.91
本期申购	81,656,496.19	81,656,496.19
本期赎回(以“-”号填列)	-303,362,283.99	-303,362,283.99
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	10,181,419.11	10,181,419.11

金额单位：人民币元

中航航空宝 B		
项目	本期 2022 年 6 月 24 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	-	-
本期申购	142,606,216.32	142,606,216.32
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	142,606,216.32	142,606,216.32

注：本期申购包含红利再投资、基金转换入份额；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

中航航空宝 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	1,678,542.03	-	1,678,542.03
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,678,542.03	-	-1,678,542.03
本期末	-	-	-

单位：人民币元

中航航空宝 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	58,675.61	-	58,675.61
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-58,675.61	-	-58,675.61
本期末	-	-	-

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	65,495.00

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	60.91
其他	9.05
合计	65,564.96

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期本基金无股票投资收益——买卖股票差价收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,843,799.53
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	9,300.87
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,853,100.40

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	330,156,303.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	328,632,661.86
减：应计利息总额	1,514,341.07
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	9,300.87

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

本报告期本基金无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

本报告期本基金无公允价值收益。

6.4.7.21 其他收入

本报告期本基金无其他收入。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	11,404.81
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	200.00
合计	89,712.18

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发生变化的情况。

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
国泰君安证券股份有限公司	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
----------	----------------

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	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 成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	8,784,200.00	100.00%	-	-

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

本报告期及上年度可比期间本基金未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	321,060.61	479,492.86
其中：支付销售机构的客户维护费	8,566.11	29,817.95

注：本基金的管理费按前一日资产净值 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，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，于次月首日起 3 个工作日内按照双方约定的方式从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	79,479.12	116,240.68

注：本基金的托管费按前一日资产净值 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，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，于次月首日起 3 个工作日内按照双方约定的方式从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航航空宝 A	中航航空宝 B	合计
中航基金管理有限公司	133,692.33	234.37	133,926.70
国泰君安证券股份有限公司	274.87	-	274.87
中航证券有限公司	3,357.83	-	3,357.83
合计	137,325.03	234.37	137,559.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	中航航空宝 A	中航航空宝 B	合计
中航基金管理有限公司	174,406.60	-	174,406.60
国泰君安证券股份有限公司	307.43	-	307.43
中航证券有限公司	4,592.25	-	4,592.25
合计	179,306.28	-	179,306.28

注：本基金各类基金份额按照不同费率计提销售服务费，A 类基金份额的年销售服务费率为 0.15%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。各类销售服务费的计算公式具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金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，于次月首日起 3 个工作日内按照双方约定的方式从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	中航航空宝 A	中航航空宝 B
基金合同生效日（2017 年 1 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	221,044,225.61	-
报告期间申购/买入总份额	1,510,713.27	142,606,216.32
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	222,554,938.88	-
报告期末持有的基金份额	0.00	142,606,216.32
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	93.34%
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	中航航空宝 A	中航航空宝 B

基金合同生效日（2017 年 1 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	180,086,561.37	-
报告期内申购/买入总份额	101,894,312.98	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	60,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	221,980,874.35	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	54.33%	-

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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 1 月 1 日至 2021 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
国泰君安证券股份有限公司	3,257,673.03	65,564.96	3,655,213.10	46,868.96

注：①包括活期存款，存在托管银行的定期存款，基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司的证券交易结算资金，即结算备付金、交易保证金；

②托管人国泰君安证券股份有限公司所保管的托管账户开立在交通银行股份有限公司。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

中航航空宝A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
1,690,909.10	-	-12,367.07	1,678,542.03	-

中航航空宝B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
51,277.44	-	7,398.17	58,675.61	-

6.4.12 期末（2022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**

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括债券、同业存单等。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保持基金资产安全性、流动性的基础上，力求超过业绩比较基准的稳定收益。

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业务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。

基金的银行存款存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该银行存款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。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券(上年末：无)。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,262,280.87	39,987,442.76
合计	20,262,280.87	39,987,442.76

注：未评级债券主要为国债、政策性金融债、中央票据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	109,269,185.65	159,301,383.12
合计	109,269,185.65	159,301,383.12

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	20,115,561.06	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	20,115,561.06	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末均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

本期末及上年度末均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于开放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约定了巨额赎回条款，明确了在特殊情况下赎回申请的处理方式，控制因发生巨额赎回等带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。针对投资品种变现的流动性风

险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资的不活跃品种(信用债、资产支持证券等)来实现。本基金能够通过出售所持有的证券应对流动性需求，此外本基金还可通过债券回购业务借入短期资金应对流动性需求。

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，本基金所承担的全部金融负债的合同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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即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《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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期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。

本报告期内，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过债券回购业务借入短期资金应对流动性需求，债券正回购的资金余额不超过基金资产净值的 20%。本报告期末，基金投资组合平均剩余期限为 110 天，现金、国债、央票、政策性金融债及五个交易日到期的其他金融工具占比 15.28%。投资标的均为信用评级高、流动性良好、交易活跃的证券品种，主要构成为利率债、短期融资券和银行间同业存单。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,256,284.41	-	-	-	-	-	3,256,284.41
存出保证金	1,388.62	-	-	-	-	-	1,388.62
交易性金融资产	29,943,067.84	29,965,844.52	89,738,115.22	-	-	-	149,647,027.58
应收申购款	-	-	-	-	-	60,300.00	60,300.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	6,882.57
资产总计	33,200,740.87	29,965,844.52	89,738,115.22	-	-	60,300.00	152,965,000.61
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,437.34	47,437.34
应付托管费	-	-	-	-	-	13,146.14	13,146.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,367.92	21,367.92
应交税费	-	-	-	-	-	1,127.34	1,127.34
应付利润	-	-	-	-	-	7,883.89	7,883.89
其他负债	-	-	-	-	-	86,402.55	86,402.55
负债总计	-	-	-	-	-	177,365.18	177,365.18
利率敏感度缺口	33,200,740.87	29,965,844.52	89,738,115.22	-	-	-117,065.18	152,787,635.43
上年度末 2021年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,319,298.20	-	-	-	-	-	7,319,298.20
交易性金融资产	49,959,484.24	119,415,671.41	29,913,670.23	-	-	-	199,288,825.88
买入返售金融资产	25,000,357.50	-	-	-	-	-	25,000,357.50
其他资产	-	-	-	-	-	557,316.24	557,316.24

应收申购款	-	-	-	-	-	10,100.00	10,100.00
资产总计	82,279,139.94	119,415,671.41	29,913,670.23	-	-	567,416.24	232,175,897.82
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	66,431.10	66,431.10
应付托管费	-	-	-	-	-	16,104.49	16,104.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,195.98	30,195.98
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1,241.02	1,241.02
应付利润	-	-	-	-	-	12,852.79	12,852.79
其他负债	-	-	-	-	-	161,865.53	161,865.53
负债总计	-	-	-	-	-	288,690.91	288,690.91
利率敏感度缺口	82,279,139.94	119,415,671.41	29,913,670.23	-	-	278,725.33	231,887,206.91

注：以上比较信息已根据最新的《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〉》中的格式要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-115,510.42	-86,169.86
市场利率下降 25 个基点	115,760.04	86,258.70	

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

本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有权益类证券、贵金属投资及权证投资等，因此无重大其他价格风险敞口。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金无其他价格风险敞口。

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	149,647,027.58	199,288,825.88
第三层次	-	-
合计	149,647,027.58	199,288,825.88

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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	固定收益投资	149,647,027.58	97.83
	其中:债券	149,647,027.58	97.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	3,256,284.41	2.13
4	其他各项资产	61,688.62	0.04
5	合计	152,965,000.61	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	0.18	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	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个交易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

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	110
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 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	21.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	19.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	6.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	52.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.86	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,262,280.87	13.26
	其中：政策性金融债	20,262,280.87	13.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,115,561.06	13.17
6	中期票据	-	-
7	同业存单	109,269,185.65	71.52
8	其他	-	-
9	合计	149,647,027.58	97.94
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例(%)
1	112216022	22 上海银行 CD022	300,000	29,943,067.84	19.60
2	112106294	21 交通银行 CD294	200,000	19,840,098.81	12.99
3	112108191	21 中信银行 CD191	200,000	19,763,784.52	12.94
4	210216	21 国开 16	100,000	10,159,427.75	6.65
5	220201	22 国开 01	100,000	10,102,853.12	6.61
6	12281650	22 津城建 SCP031	100,000	10,097,615.63	6.61
7	12281852	22 苏交通 SCP010	100,000	10,017,945.43	6.56
8	112121288	21 渤海银行 CD288	100,000	9,976,430.04	6.53
9	112115230	21 民生银行 CD230	100,000	9,971,469.05	6.53
10	112103131	21 农业银行 CD131	100,000	9,933,947.23	6.50

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1176%
报告期内偏离度的最低值	0.0162%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0481%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按实际利率计算账面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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

7.9.2 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

22 上海银行 CD022（代码：112216022）

2022 年 2 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行 2015 年 3 月至 7 月同业投资业务违规接受第三方金融机构担保，责令改正，并处罚款 240 万元。

2021 年 11 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行未按规定报送统计报表，罚款 20 万元。

2021 年 7 月 2 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行 2018 年 12 月，该行某笔同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则；2019 年 11 月，该行某笔经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则；2019 年 2 月至 4 月，该行部分个人贷款违规用于购房；2020 年 5 月至 7 月，该行对部分个人住房贷款借款人偿债能力审查不审慎；2020 年 7 月，该行在助贷环节对第三方机构收费管理严重违反审慎经营规则；2020 年 6 月至 12 月，该行部分业务以贷收费，责令改正，并处罚款共计 460 万元。

21 交通银行 CD294（代码：112106294）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对交通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；贸易融资业务 EAST 数据存在偏差；漏报贷款核销业务 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；未报送其他担保类业务 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；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《对公信贷业务借据》表错报；EAST 系统《关联关系》表漏报；理财产品登记不规范；2018 年行政处罚问题依然存在，罚款 420 万元。

2021 年 10 月 20 日，国家外汇管理局上海市分局对交通银行因未按规定办理内存外贷业务等违法违规事项，责令改正，给予警告，处罚款 340 万元人民币，没收违法所得 823,166.01 元人民

币。

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 中信银行 CD191（代码：112108191）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对中信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：漏报抵押物价值 EAST 数据；未报送权益类投资业务 EAST 数据；漏报跟单信用证业务 EAST 数据；漏报其他担保类业务 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《关联关系》表漏报；面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产；2018 年行政处罚问题依然存在，罚款 290 万元。

2021 年 11 月 20 日，国家市场监督管理总局对中信银行与福建百度博瑞网络科技有限公司新设合营企业违反反垄断法，对中信银行罚款 50 万元。

21 国开 16（代码：210216）、22 国开 01（代码：220201）

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 CD288（代码：112121288）

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。

21 民生银行 CD230（代码：112115230）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对民生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；债券投资业务 EAST 数据存在偏差；未报送权益类投资业务 EAST 数据；未报送公募基金投资业务 EAST 数据；未报送其他担保类业务 EAST 数据；未报送不可无条件撤销的贷款承诺业务 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；报送不实数据；面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产，罚款 490 万元。

2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对民生银行监管发现问题屡查屡犯；检查发现问题整改不到位；对责任人员的责任认定和问责不到位；内部制度管理不足，个别制度与监管要求冲突；配合现场检查不力；信息系统管控有效性不足；未向监管部门真实反映业务数据；

未严格执行理财投资合作机构名单制管理；理财业务整改转型不符合监管要求；违规调整理财产品收益；理财产品收益兑付不合规；违规调节理财业务利润；使用内部账户截留理财产品浮动管理费收入和承接风险资产；理财产品间相互交易资产调节收益；理财产品未实现账实相符、单独托管；理财产品投资清单未反映真实情况，合格投资者认定不审慎；开放式公募理财产品投资杠杆水平超标；公募理财产品持有单只证券市值比例超标；开放式公募理财产品流动性资产持有比例不达标；理财产品信息登记不规范；理财产品信息披露不规范；理财产品托管不尽职；违规开展委托资产管理业务；同业业务未实行专营部门制；同业业务交易对手管理不健全；同业业务统一授信管理不到位；违规将转贴现票据转为投资资产，未真实反映票据规模；会计核算不规范；发行虚假结构性存款产品；未对信贷资产收益权转让业务对应资产计提资本；委托贷款委托人资质审查不审慎，罚款 11450 万元。

2021 年 7 月 5 日，中国银行间市场交易商协会对民生银行存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为：一是作为银行间债券市场做市商，在开展做市业务时主导开展倒量等虚假交易。2020 年四季度多个交易日内，民生银行作为债券的最初卖出方和最终买入方，主导并开展了多组当日较短时间内卖出后买入、价量相同的闭环交易。相关交易并未影响民生银行持仓，并未反映合理经济目的，实质上是倒量的虚假交易。二是作为债务融资工具存续期管理机构，未及时召开“18 乍浦建设 MTN001”持有人会议，持有人会议组织召开不符合规定程序。根据银行间债券市场相关自律规定，对民生银行予以通报批评；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。

21 农业银行 CD131（代码：112103131）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对农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：漏报贷款核销业务 EAST 数据；未报送权益类投资业务 EAST 数据；未报送公募基金投资业务 EAST 数据；未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；其他担保类业务 EAST 数据存在偏差；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；未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；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《对公信贷业务借据》表错报；EAST 系统《关联关系》表漏报；理财产品登记不规范；2018 年行政处罚问题依然存在，罚款 480 万元。

2021 年 12 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行制定文件要求企业对公账户必

须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权；农业银行河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求，违法行为情节较为严重，罚款 150 万元。

本基金投资 22 上海银行 CD022、21 交通银行 CD294、21 中信银行 CD191、21 国开 16、22 国开 01、21 渤海银行 CD288、21 民生银行 CD230、21 农业银行 CD131 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金除 22 上海银行 CD022、21 交通银行 CD294、21 中信银行 CD191、21 国开 16、22 国开 01、21 渤海银行 CD288、21 民生银行 CD230、21 农业银行 CD131 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。

7.9.3 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	1,388.62
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	60,300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	61,688.62

7.9.4 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。

§ 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)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中航航空宝 A	4,986	2,042.00	2,667,730.56	26.20%	7,513,688.55	73.80%
中航航空宝 B	1	142,606,216.32	142,606,216.32	100.00%	-	-
合计	4,987	30,637.18	145,273,946.88	95.08%	7,513,688.55	4.92%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	其他机构	1,555,440.58	1.02%
2	基金类机构	1,080,629.49	0.71%
3	个人	880,410.51	0.58%
4	个人	348,303.91	0.23%
5	个人	328,966.99	0.22%
6	个人	305,332.55	0.20%
7	个人	300,778.23	0.20%
8	个人	227,176.01	0.15%
9	个人	200,839.88	0.13%
10	个人	200,456.77	0.13%

8.3 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	中航航空宝 A	2.49	0.00%
	中航航空宝 B	-	-
	合计	2.49	0.00%

8.4 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的情况

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中航航行宝 A	中航航行宝 B
基金合同生效日（2017 年 1 月 25 日）基金份额总额	520,655,938.43	-
本报告期期初基金份额总额	231,887,206.91	-
本报告期基金总申购份额	81,656,496.19	142,606,216.32
减：本报告期基金总赎回份额	303,362,283.99	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,181,419.11	142,606,216.32

注：基金总申购份额包含基金红利再投份额、基金转换入份额，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

无。

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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2：交易单元的选择标准和程序

(1) 实力雄厚，信誉良好；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，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。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用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
国泰君安股份有限公司	8,784,200.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本报告期内本基金不存在偏离度绝对值超过 0.5% 的情况。

10.9 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	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 14 日
2	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书（2022 年第 1 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 18 日
3	中航航空宝货币市场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	2022 年 1 月 18 日
4	中航航空宝货币市场基金 2021 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	2022 年 1 月 21 日
5	中航基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 28 日
6	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 16 日
7	关于中航基金管理有限公司旗下	中国证券报、管理人网站、中国	2022 年 3 月 18 日

	部分基金增加销售机构的公告	证监会基金电子披露网站	
8	中航航空宝货币市场基金 2021 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 30 日
9	中航航空宝货币市场基金 2022 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	2022 年 4 月 21 日
10	关于中航基金管理有限公司旗下中航航空宝货币市场基金增加销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 27 日
11	关于中航航空宝货币市场基金增聘基金经理的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 24 日
12	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书（2022 年第 2 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 25 日
13	中航航空宝货币市场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	2022 年 5 月 25 日
14	中航基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 11 日
15	关于中航航空宝货币市场基金新增 B 类基金份额、调低管理费并修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 23 日
16	中航航空宝货币市场基金托管协议	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 23 日
17	中航航空宝货币市场基金基金合同	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 23 日
18	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书（2022 年第 3 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 23 日
19	中航航空宝货币市场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	2022 年 6 月 23 日
20	关于中航航空宝货币市场基金 B 类份额增加销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 27 日
21	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 30 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	20220101-20220630	221,044,225.61	1,561,990.71	80,000,000.00	142,606,216.32	93.34%
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>							

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航行宝货币市场基金募集的文件
2. 《中航航行宝货币市场基金基金合同》
3. 《中航航行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. 报告期内中航航行宝货币市场基金在指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号北京亚洲金融大厦B座1001、1007、1008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

2022年8月30日