

中航混改精选混合型证券投资基金 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，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（如有）、财务会计报告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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§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.....	12
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.....	13
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.....	51
7.1 期末基金资产组合情况.....	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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的情况.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中航混改精选混合型证券投资基金	
基金简称	中航混改精选	
基金主代码	004936	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 14 日	
基金管理人	中航基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,510,826.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中航混改精选 A	中航混改精选 C
下属分级基金的交易代码:	004936	004937
报告期末下属分级基金的份额总额	872,217.08 份	12,638,609.40 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，主要投资于受益于混合所有制改革相关证券，结合大类资产配置策略，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资于已经实施混合所有制改革和具有混合所有制改革预期中央国有企业及地方国有企业以及作为混改重点受益的部分行业的非国有上市公司。本基金还将重点关注流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。 本基金所采取的投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武国强
	联系电话	010-56716188
	电子邮箱	wuguoqiang@avicfund.cn
客户服务电话	400-666-2186	95580
传真	010-56716198	010-68858120
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	北京市西城区金融大街 3 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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	100101	100808
法定代表人	杨彦伟	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	中航混改精选 A	中航混改精选 C
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1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	-363,834.86	-24,695,047.12
本期利润	-125,880.92	-24,593,687.80
加权平均基金份额本期利润	-0.1455	-0.2430
本期加权平均净值利润率	-10.96%	-18.48%
本期基金份额净值增长率	-9.96%	-10.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	138,689.83	1,726,979.17
期末可供分配基金份额利润	0.1590	0.1366
期末基金资产净值	1,146,242.49	16,281,246.13
期末基金份额净值	1.3142	1.2882
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	31.42%	28.82%

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

中航混改精选 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
过去一个月	1.99%	0.77%	7.09%	0.80%	-5.10%	-0.03%
过去三个月	1.04%	1.18%	4.82%	1.07%	-3.78%	0.11%
过去六个月	-9.96%	1.18%	-6.69%	1.09%	-3.27%	0.09%
过去一年	-7.72%	0.98%	-10.09%	0.93%	2.37%	0.05%
过去三年	31.67%	1.07%	14.94%	0.95%	16.73%	0.12%

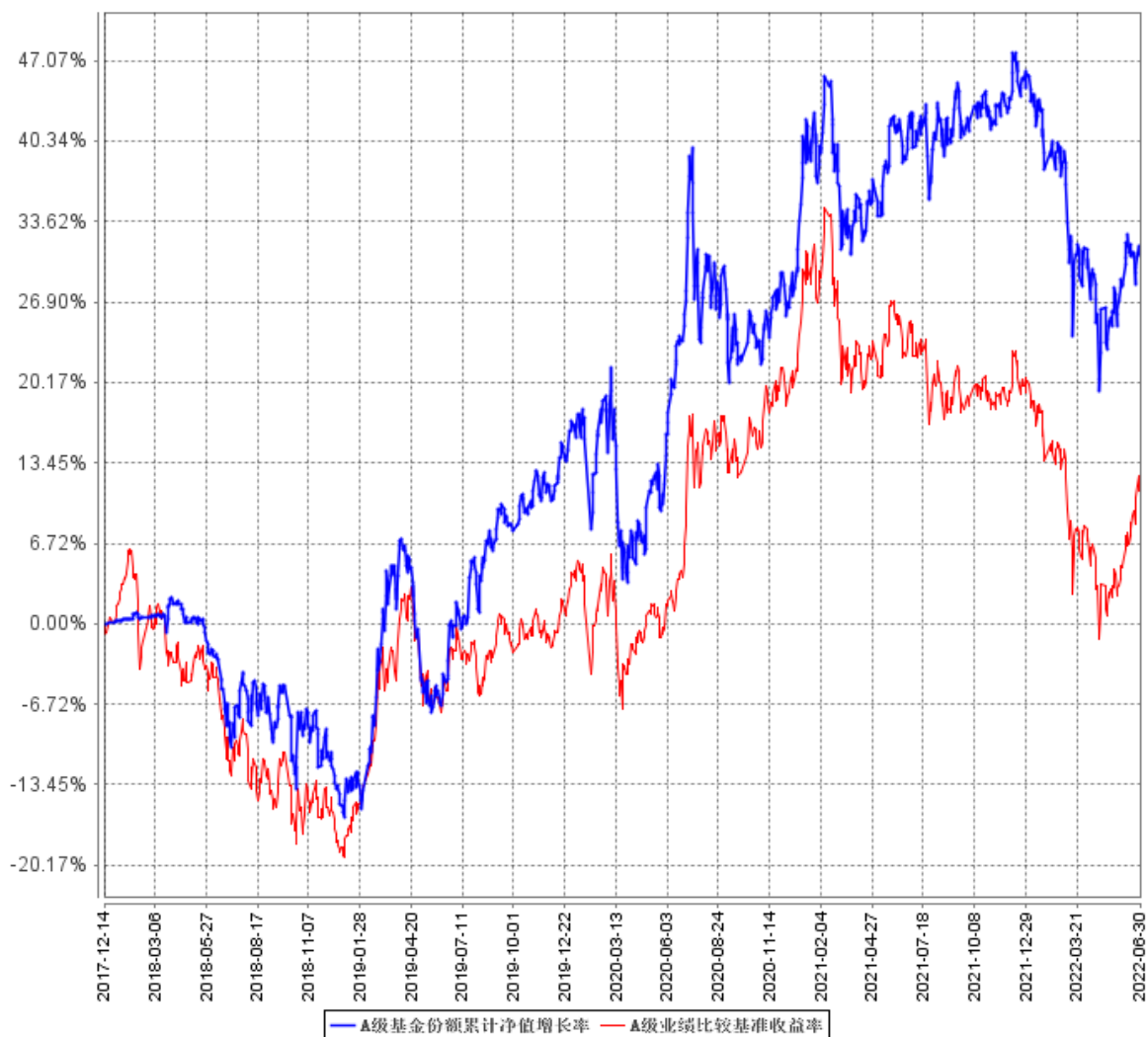
自基金合同 生效起至今	31.42%	1.05%	12.31%	0.98%	19.11%	0.07%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

中航混改精选 C

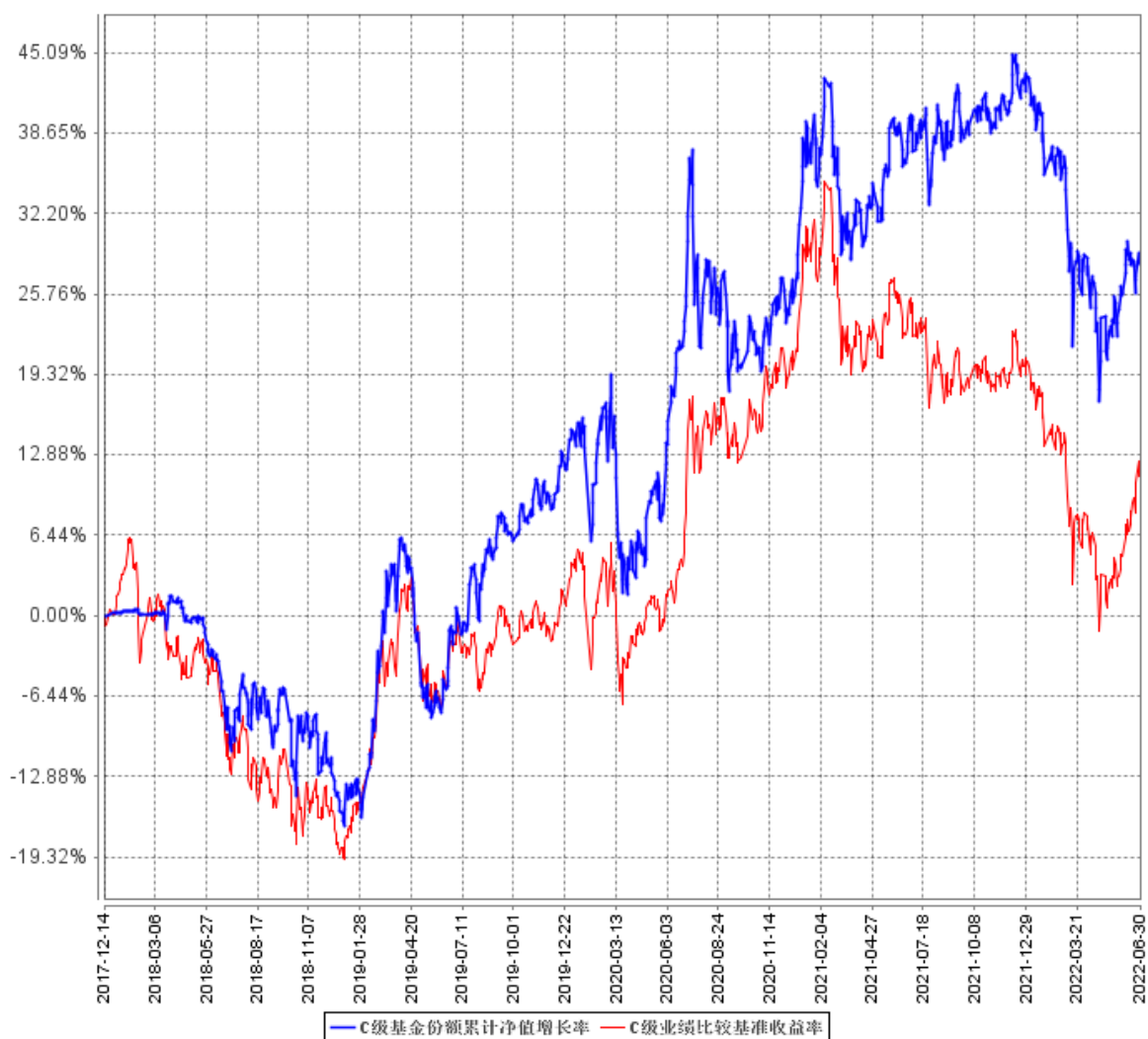
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①—③	②—④
过去一个月	1.98%	0.77%	7.09%	0.80%	-5.11%	-0.03%
过去三个月	1.00%	1.18%	4.82%	1.07%	-3.82%	0.11%
过去六个月	-10.02%	1.18%	-6.69%	1.09%	-3.33%	0.09%
过去一年	-7.82%	0.98%	-10.09%	0.93%	2.27%	0.05%
过去三年	30.56%	1.07%	14.94%	0.95%	15.62%	0.12%
自基金合同 生效起至今	28.82%	1.05%	12.31%	0.98%	16.51%	0.07%

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

A级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



C级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		
韩浩	基金经理	2017 年 12 月 14 日	-	14	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，现担任公司总经理助理、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》、《中航混改精选混合型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 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

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

2022 年上半年，上证综指收于 3398.62 点，下跌-6.63%；沪深 300 指数收于 4485.01 点，下跌-9.22%；创业板指数收于 2810.60 点，下跌-15.41%。由于受国际形势和国内疫情影响，A 股 1-4 月经历了明显调整，随后在一系列稳定经济的政策出台后，市场在五、六月份强力反弹。整体而言，国内复工复产基本完成，经济重回到正常的轨道上来，与此同时，美联储紧缩政策对国内资本市场的负面影响也在边际减弱。市场的主线从“稳增长”逐渐切换到疫情复苏与成长板块。

本基金的投资思路未发生改变，严格控制产品的波动率，重点关注混改相关概念标的，优选行业龙头公司，配置了银行、能源、通信等行业内具有性价比优势的标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航混改精选 A 基金份额净值为 1.3142 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.96%；截至本报告期末中航混改精选 C 基金份额净值为 1.2882 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.02%；同期业绩比较基准收益率为-6.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济最困难时期已过，北京上海复工复产加速，宽货币政策和财政政策支持力度加大，下半年经济底逐步清晰，有望实现“V”型反弹。但是要警惕美国通胀高企使得美联储加息提速，外围经济衰退风险增加，届时或将影响 A 股市场风险偏好，总体预计市场走势与国内经济走势更具有同步性。

从配置来看，疫情管控期间对消费场景抑制明显，尤其在消费者集中的大城市影响更大。随

着疫情的缓解，包括可选消费、社会服务业、食品饮料等行业的弹性更大。此外，也持续跟踪以新能源、半导体、军工等为代表的高景气资产。

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历。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，本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金自 2022 年 5 月 25 日起基金资产净值开始低于 5000 万元，2022 年 5 月 25 日当日基金资产净值为 36,724,093.79 元。2022 年 6 月 30 日，本基金资产净值为 17,427,488.62 元。本基金资产净值已连续 26 个工作日低于 5000 万元。

§ 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中航混改精选混合型证券投资基金（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认真地复核，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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：中航混改精选混合型证券投资基金

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	1,887,640.46	34,606,981.58
结算备付金		707,948.87	1,518,864.64
存出保证金		106,800.36	29,675.64
交易性金融资产	6.4.7.2	14,841,063.03	275,487,860.10
其中：股票投资		14,841,063.03	166,655,220.10
基金投资		-	-
债券投资		-	108,832,640.00
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		93,160.93	74,279.04
应收股利		-	-
应收申购款		820.00	201,978.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,795,273.58
资产总计		17,637,433.65	313,714,912.75
负债和净资产			
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		-	85,000,000.00
应付清算款		-	-

应付赎回款		1,191.01	34,683.76
应付管理人报酬		11,384.47	153,028.30
应付托管费		1,423.07	19,128.52
应付销售服务费		1,330.76	19,021.48
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	194,615.72	242,358.99
负债合计		209,945.03	85,468,221.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	13,510,826.48	159,422,624.66
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,916,662.14	68,824,067.04
净资产合计		17,427,488.62	228,246,691.70
负债和净资产总计		17,637,433.65	313,714,912.75

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额合计为 13,510,826.48 份，其中中航混改精选 A 基金份额净值 1.3142 元，基金份额总额 872,217.08 份；中航混改精选 C 基金份额净值 1.2882 元，基金份额总额 12,638,609.40 份；

②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：中航混改精选混合型证券投资基金

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		-23,411,883.65	13,241,924.00
1.利息收入		46,540.98	885,678.44
其中：存款利息收入	6.4.7.13	46,540.98	130,072.94
债券利息收入		-	752,794.54
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	2,810.96
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-23,805,996.66	15,154,650.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-24,711,871.38	13,952,312.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	513,810.32	-
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	392,064.40	1,202,337.98
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	339,313.26	-2,804,198.10
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	8,258.77	5,792.71
减：二、营业总支出		1,307,685.07	1,889,004.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	547,644.09	806,998.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	68,455.51	100,874.80
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	67,884.15	99,794.23
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		532,205.38	630,617.23
其中：卖出回购金融资产支出		532,205.38	630,617.23
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	91,495.94	250,719.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,719,568.72	11,352,919.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,719,568.72	11,352,919.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-24,719,568.72	11,352,919.86

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：中航混改精选混合型证券投资基金

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)	159,422,624.66	-	68,824,067.04	228,246,691.70
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)	159,422,624.66	-	68,824,067.04	228,246,691.70
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-145,911,798.18	-	-64,907,404.90	-210,819,203.08
(一)、综合收益总额	-	-	-24,719,568.72	-24,719,568.72
(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)	-145,911,798.18	-	-40,187,836.18	-186,099,634.36
其中：1.基金申购款	20,647,051.62	-	5,211,850.91	25,858,902.53
2.基金赎回款	-166,558,849.80	-	-45,399,687.09	-211,958,536.89
(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)	-	-	-	-
(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)	13,510,826.48	-	3,916,662.14	17,427,488.62
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)	110,461,809.22	-	34,597,481.40	145,059,290.62
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)	110,461,809.22	-	34,597,481.40	145,059,290.62
三、本期增减变动额	44,429,333.66	-	27,005,038.03	71,434,371.69

(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	11,352,919.86	11,352,919.86
(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)	44,429,333.66	-	15,652,118.17	60,081,451.83
其中: 1.基金申购款	95,878,149.56	-	33,741,221.31	129,619,370.87
2.基金赎回款	-51,448,815.90	-	-18,089,103.14	-69,537,919.04
(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)	-	-	-	-
(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)	154,891,142.88	-	61,602,519.43	216,493,662.31

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:

<u>刘建</u>	<u>裴荣荣</u>	<u>韩丹</u>
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

中航混改精选混合型证券投资基金(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[2017]978号文《关于准予中航混改精选混合型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《中航混改精选混合型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2017年12月14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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。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308,864,406.53份,有效认购户数为2190户。其中,认购资金在募集期间产生的利息折合基金份额21,421.77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《中航混改精选混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、

地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、债券回购）、资产支持证券、银行存款、货币市场工具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）。

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 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股票投资、债券投资、同业存单、资产支持证券和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他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中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商业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。

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，按照公允价值进行后续计量；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

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为权证投资)等按如下原则确定公允价值并进行估值：

(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。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

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 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(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后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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按直线法近似计算。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,而 C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同,本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

2、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

3、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

4、基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 分部报告

无。

6.4.4.13 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 34,606,981.58 元、结算备付金金额 1,518,864.64 元、存出保证金金额 29,675.64 元、应收利息金额 1,795,273.58 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 34,614,664.79 元、结算备付金金额 1,519,616.49 元、存出保证金金额 29,690.27 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 275,487,860.10 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 277,274,683.99 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：卖出回购金融资产款金额 85,000,000.00 元、应付交易费用金额 78,645.43 元、应付利息金额 11,705.01 元、其他负债金额 152,008.55 元。新金融工具准则下金融负债科目及账面价值调整为：卖出回购金融资产款金额 85,011,705.01 元、应付交易费用金额 0.00 元、应付利息金额 0.00 元、其他负债金额 230,653.98 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【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【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、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 04 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、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【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. 对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税；

4. 存款利息收入不征收增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税；
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；
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。

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	1,887,640.46
等于：本金	1,887,271.84
加：应计利息	368.62
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：	1,887,640.46

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			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,093,935.52	-	14,841,063.03	-252,872.49
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	15,093,935.52	-	14,841,063.03	-252,872.49

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 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	89,719.78
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	104,895.94
合计	194,615.72

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

中航混改精选 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	883,314.60	883,314.60
本期申购	99,283.84	99,283.84
本期赎回(以“-”号填列)	-110,381.36	-110,381.36
- 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	872,217.08	872,217.08

金额单位：人民币元

中航混改精选 C		
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	158,539,310.06	158,539,310.06
本期申购	20,547,767.78	20,547,767.78
本期赎回(以“-”号填列)	-166,448,468.44	-166,448,468.44
- 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	12,638,609.40	12,638,609.40

注：本期申购包含基金转换入份额；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

中航混改精选 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	514,287.03	-108,340.11	405,946.92
本期利润	-363,834.86	237,953.94	-125,880.92

本期基金份额交易产生的变动数	-11,762.34	5,721.75	-6,040.59
其中：基金申购款	46,162.30	-13,416.90	32,745.40
基金赎回款	-57,924.64	19,138.65	-38,785.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	138,689.83	135,335.58	274,025.41

单位：人民币元

中航混改精选 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	87,561,848.83	-19,143,728.71	68,418,120.12
本期利润	-24,695,047.12	101,359.32	-24,593,687.80
本期基金份额交易产生的变动数	-61,139,822.54	20,958,026.95	-40,181,795.59
其中：基金申购款	10,835,918.01	-5,656,812.50	5,179,105.51
基金赎回款	-71,975,740.55	26,614,839.45	-45,360,901.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,726,979.17	1,915,657.56	3,642,636.73

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	33,183.84
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	12,881.47
其他	475.67
合计	46,540.98

注：其他包括结算保证金利息收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	204,955,696.19
减：卖出股票成本总额	229,222,505.80
减：交易费用	445,061.77
买卖股票差价收入	-24,711,871.38

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	640,489.44
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-126,679.12
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	513,810.32

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	168,730,207.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	165,665,735.90
减：应计利息总额	3,190,924.29
减：交易费用	226.12
买卖债券差价收入	-126,679.12

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	392,064.40
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	392,064.40

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	339,313.26
——股票投资	129,282.36

——债券投资	210,030.90
——资产支持证券投资	-
——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	339,313.26

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	8,258.77
合计	8,258.77

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	13,388.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	91,495.94

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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

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 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	273,313,551.19	100.00%	113,238,350.92	100.00%

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
中航证券有限公司	222,162,347.90	100.00%	89,907,660.10	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中航证券有限公司	1,207,400,000.00	100.00%	1,930,500,000.00	100.00%

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 2022年1月1日至2022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	199,872.75	100.00%	89,719.78	100.00%
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	82,811.01	100.00%	8,660.82	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和市场信息服务。

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	547,644.09
其中：支付销售机构的客户维护费	19,447.22	11,188.39

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的0.8%的年费率计算。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

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，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划款指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内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	68,455.51	100,874.80

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划款指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内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。

6.4.10.2.3 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		
	中航混改精选 A	中航混改精选 C	合计
中航基金管理有限公司	-	61,431.61	61,431.61
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	65.79	65.79
中航证券有限公司	-	260.96	260.96
合计	-	61,758.36	61,758.36
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		
	中航混改精选 A	中航混改精选 C	合计
中航基金管理有限公司	-	97,207.48	97,207.48
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	68.64	68.64
中航证券有限公司	-	849.39	849.39
合计	-	98,125.51	98,125.51

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按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

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：基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划款指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内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。

6.4.10.3 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

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
邮储银行股份有限公司	2,702,389.69	46,540.98	32,843,370.03	130,072.94

注：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。

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

无。

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（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**

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
600941	中国移动	2021 年 12 月 24 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	57.58	60.23	87,363	5,030,361.54	5,261,873.49	-
600938	中国海油	2022 年 4 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	10.80	16.16	84,004	907,243.20	1,357,504.64	-
688153	唯捷创芯	2022 年 4 月 1 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	66.60	46.51	1,652	110,023.20	76,834.52	-
688171	纬德信息	2022 年 1 月 20 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	28.68	22.76	2,821	80,906.28	64,205.96	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	3.80	6.39	2,962	11,255.60	18,927.18	-
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	13.73	16.01	928	12,741.44	14,857.28	-
301201	诚达药业	2022 年 1 月 12 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	72.69	71.48	207	15,046.83	14,796.36	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	17.27	14.82	948	16,371.96	14,049.36	-
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	39.30	37.90	370	14,541.00	14,023.00	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	46.80	54.38	247	11,559.60	13,431.86	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	33.68	46.70	264	8,891.52	12,328.80	-
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	18.39	25.84	469	8,624.91	12,118.96	-
301263	泰恩	2022 年 3 月 1 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	19.93	31.38	378	7,533.54	11,861.64	-

	康	月 22 日	月(含)	售锁定							
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	11.40	20.44	577	6,577.80	11,793.88	-	
301187	欧圣电气	2022 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	21.33	22.90	473	10,089.09	10,831.70	-	
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	72.87	45.67	219	15,957.80	10,001.73	-	锁定期送股
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	19.09	21.88	452	8,628.68	9,889.76	-	
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	29.67	33.88	291	8,633.97	9,859.08	-	
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	56.88	56.40	168	9,555.84	9,475.20	-	
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	8.05	10.08	928	7,470.40	9,354.24	-	
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	28.50	34.91	261	7,438.50	9,111.51	-	
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	26.27	32.71	277	7,276.79	9,060.67	-	
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	22.55	37.67	237	5,344.35	8,927.79	-	
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	48.59	31.38	270	13,118.40	8,472.60	-	锁定期送股
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	23.18	16.22	515	11,939.83	8,353.30	-	锁定期送股
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	39.07	29.97	272	10,627.04	8,151.84	-	
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	15.37	15.99	493	7,577.41	7,883.07	-	
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	15.64	20.36	379	5,927.56	7,716.44	-	
301123	奕东电子	2022 年 1 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	37.23	25.37	295	10,982.85	7,484.15	-	
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	109.04	84.91	87	9,486.48	7,387.17	-	锁定期送股
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	33.98	28.96	246	8,359.08	7,124.16	-	
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	32.69	32.03	221	7,225.00	7,078.63	-	锁定期送股
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	40.25	30.58	231	9,297.75	7,063.98	-	
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	35.68	29.84	229	8,170.72	6,833.36	-	

301148	嘉戎技术	2022年4月14日	1-6个月(含)	网下配售锁定	38.39	23.97	284	10,902.76	6,807.48	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	1-6个月(含)	网下配售锁定	39.88	31.09	211	8,414.68	6,559.99	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	1-6个月(含)	网下配售锁定	31.98	26.29	245	7,835.10	6,441.05	-
300834	星辉环材	2022年1月6日	1-6个月(含)	网下配售锁定	55.57	30.01	204	11,336.28	6,122.04	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	1-6个月(含)	网下配售锁定	56.69	41.87	144	8,163.36	6,029.28	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	1-6个月(含)	网下配售锁定	96.36	87.86	65	6,263.28	5,710.90	锁定期送股
301258	富士莱	2022年3月21日	1-6个月(含)	网下配售锁定	48.30	41.69	136	6,568.80	5,669.84	-
301279	金道科技	2022年4月6日	1-6个月(含)	网下配售锁定	31.20	23.04	245	7,644.00	5,644.80	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	1-6个月(含)	网下配售锁定	30.82	21.50	258	7,951.56	5,547.00	-
301110	青木股份	2022年3月4日	1-6个月(含)	网下配售锁定	63.10	39.85	110	6,941.00	4,383.50	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	1-6个月(含)	网下配售锁定	64.08	37.50	114	7,305.12	4,275.00	-

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

本基金为偏股混合型基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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严格控制风险的前提下，力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。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券及同业存单（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	-	108,832,640.00
合计	-	108,832,640.00

注：未评级债券一般为国债、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。

6.4.13.2.3 按短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

本期末及上年度末均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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息。

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》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发行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%。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间市场上市，部分股票资产流通暂时受限无法自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过债券回购业务借入短期资金应对流动性需求，债券正回购资金余额不超过基金持有债券资产的公允价值，且不超过基金资产净值的 40%。基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不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。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

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	1,887,640.46	-	-	-	-	-	1,887,640.46
结算备付金	707,948.87	-	-	-	-	-	707,948.87
存出保证金	106,800.36	-	-	-	-	-	106,800.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	14,841,063.03	14,841,063.03
应收申购款	-	-	-	-	-	820.00	820.00
其他资产	-	-	-	-	-	93,160.93	93,160.93
资产总计	2,702,389.69	-	-	-	-	14,935,043.96	17,637,433.65
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,191.01	1,191.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,384.47	11,384.47

应付托管费	-	-	-	-	-	1,423.07	1,423.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,330.76	1,330.76
其他负债	-	-	-	-	-	194,615.72	194,615.72
负债总计	-	-	-	-	-	209,945.03	209,945.03
利率敏感度缺口	2,702,389.69	-	-	-	-	14,725,098.93	17,427,488.62
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	34,606,981.58	-	-	-	-	-	34,606,981.58
结算备付金	1,518,864.64	-	-	-	-	-	1,518,864.64
存出保证金	29,675.64	-	-	-	-	-	29,675.64
交易性金融资产	-	-	108,832,640.00	-	-	166,655,220.10	275,487,860.10
应收证券清算款	-	-	-	-	-	74,279.04	74,279.04
其他资产	-	-	-	-	-	1,795,273.58	1,795,273.58
应收申购款	-	-	-	-	-	201,978.17	201,978.17
资产总计	36,155,521.86	-	108,832,640.00	-	-	168,726,750.89	313,714,912.75
负债							
卖出回购金融资产款	85,000,000.00	-	-	-	-	-	85,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	34,683.76	34,683.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	153,028.30	153,028.30
应付托管费	-	-	-	-	-	19,128.52	19,128.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-	19,021.48	19,021.48
其他负债	-	-	-	-	-	242,358.99	242,358.99
负债总计	85,000,000.00	-	-	-	-	468,221.05	85,468,221.05
利率敏感度缺口	-48,844,478.14	-	108,832,640.00	-	-	168,258,529.84	228,246,691.70

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	-	-82,921.60
	市场利率下降25个基点	-	83,048.18

注：于2022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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	14,841,063.03	85.16	166,655,220.10	73.02
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	14,841,063.03	85.16	166,655,220.10	73.02

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	819,544.92	10,546,971.65
	业绩比较基准下降 5%	-819,544.92	-10,546,971.65

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	7,709,204.84	155,201,110.50
第二层次	7,131,858.19	120,286,749.60
第三层次	-	-
合计	14,841,063.03	275,487,860.10

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	权益投资	14,841,063.03	84.15
	其中：股票	14,841,063.03	84.15
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	2,595,589.33	14.72
8	其他各项资产	200,781.29	1.14
9	合计	17,637,433.65	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	125,511.00	0.72
B	采矿业	1,592,626.64	9.14
C	制造业	5,258,897.19	30.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	144,348.00	0.83
E	建筑业	134,313.40	0.77
F	批发和零售业	102,388.12	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	241,868.00	1.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,713,821.57	32.79
J	金融业	869,798.22	4.99
K	房地产业	159,247.80	0.91
L	租赁和商务服务业	30,787.99	0.18
M	科学研究和技术服务业	248,516.18	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	27,279.74	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,474.00	0.02

Q	卫生和社会工作	144,141.18	0.83
R	文化、体育和娱乐业	44,044.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	14,841,063.03	85.16

7.2.2 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	600941	中国移动	87,363	5,261,873.49	30.19
2	600938	中国海油	84,004	1,357,504.64	7.79
3	002415	海康威视	5,900	213,580.00	1.23
4	688169	石头科技	200	123,340.00	0.71
5	300896	爱美客	200	120,002.00	0.69
6	603986	兆易创新	820	116,612.20	0.67
7	603259	药明康德	1,000	103,990.00	0.60
8	002812	恩捷股份	400	100,180.00	0.57
9	002594	比亚迪	300	100,047.00	0.57
10	300059	东方财富	3,680	93,472.00	0.54
11	601012	隆基绿能	1,400	93,282.00	0.54
12	600887	伊利股份	2,200	85,690.00	0.49
13	002371	北方华创	300	83,136.00	0.48
14	603288	海天味业	900	81,324.00	0.47
15	688981	中芯国际	1,770	79,950.90	0.46
16	600438	通威股份	1,300	77,818.00	0.45
17	688153	唯捷创芯	1,652	76,834.52	0.44
18	600309	万华化学	790	76,622.10	0.44
19	002466	天齐锂业	600	74,880.00	0.43
20	603799	华友钴业	780	74,583.60	0.43
21	002460	赣锋锂业	500	74,350.00	0.43
22	600276	恒瑞医药	1,980	73,438.20	0.42
23	000661	长春高新	300	70,026.00	0.40
24	603501	韦尔股份	400	69,212.00	0.40
25	300347	泰格医药	600	68,670.00	0.39
26	002475	立讯精密	2,000	67,580.00	0.39
27	603659	璞泰来	800	67,520.00	0.39
28	300498	温氏股份	3,100	65,999.00	0.38

29	688171	纬德信息	2,821	64,205.96	0.37
30	688599	天合光能	949	61,922.25	0.36
31	001979	招商蛇口	4,600	61,778.00	0.35
32	300014	亿纬锂能	600	58,500.00	0.34
33	002821	凯莱英	200	57,800.00	0.33
34	600406	国电南瑞	2,136	57,672.00	0.33
35	002049	紫光国微	300	56,916.00	0.33
36	601899	紫金矿业	6,100	56,913.00	0.33
37	688012	中微公司	485	56,623.75	0.32
38	688111	金山办公	286	56,376.32	0.32
39	002714	牧原股份	1,000	55,270.00	0.32
40	300015	爱尔眼科	1,215	54,395.55	0.31
41	000651	格力电器	1,600	53,952.00	0.31
42	002129	TCL 中环	900	53,001.00	0.30
43	688601	力芯微	353	52,950.00	0.30
44	600763	通策医疗	300	52,332.00	0.30
45	600795	国电电力	13,100	51,221.00	0.29
46	300124	汇川技术	768	50,588.16	0.29
47	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.29
48	601088	中国神华	1,400	46,620.00	0.27
49	603392	万泰生物	295	45,813.50	0.26
50	603833	欧派家居	300	45,204.00	0.26
51	002352	顺丰控股	800	44,648.00	0.26
52	300122	智飞生物	400	44,404.00	0.25
53	002459	晶澳科技	560	44,184.00	0.25
54	600132	重庆啤酒	300	43,980.00	0.25
55	600690	海尔智家	1,600	43,936.00	0.25
56	600031	三一重工	2,300	43,838.00	0.25
57	300782	卓胜微	320	43,200.00	0.25
58	600745	闻泰科技	500	42,555.00	0.24
59	000002	万科 A	2,062	42,271.00	0.24
60	601668	中国建筑	7,900	42,028.00	0.24
61	601288	农业银行	13,700	41,374.00	0.24
62	000858	五粮液	200	40,386.00	0.23
63	688363	华熙生物	283	40,236.94	0.23
64	601816	京沪高铁	7,800	39,156.00	0.22
65	601919	中远海控	2,810	39,059.00	0.22
66	000725	京东方 A	9,900	39,006.00	0.22
67	600000	浦发银行	4,700	37,647.00	0.22

68	002709	天赐材料	600	37,236.00	0.21
69	688036	传音控股	416	37,119.68	0.21
70	601100	恒立液压	600	37,032.00	0.21
71	603486	科沃斯	300	36,567.00	0.21
72	600016	民生银行	9,700	36,084.00	0.21
73	002271	东方雨虹	700	36,029.00	0.21
74	600104	上汽集团	2,000	35,620.00	0.20
75	600585	海螺水泥	1,000	35,280.00	0.20
76	600111	北方稀土	1,000	35,160.00	0.20
77	601799	星宇股份	200	34,200.00	0.20
78	605499	东鹏饮料	200	34,172.00	0.20
79	601225	陕西煤业	1,600	33,888.00	0.19
80	000625	长安汽车	1,950	33,774.00	0.19
81	002241	歌尔股份	1,000	33,600.00	0.19
82	002230	科大讯飞	800	32,976.00	0.19
83	601601	中国太保	1,399	32,918.47	0.19
84	002410	广联达	600	32,664.00	0.19
85	300450	先导智能	500	31,590.00	0.18
86	600919	江苏银行	4,400	31,328.00	0.18
87	601688	华泰证券	2,200	31,240.00	0.18
88	600600	青岛啤酒	300	31,176.00	0.18
89	300144	宋城演艺	2,000	30,700.00	0.18
90	603195	公牛集团	200	30,582.00	0.18
91	688561	奇安信	542	30,243.60	0.17
92	600660	福耀玻璃	700	29,267.00	0.17
93	601211	国泰君安	1,900	28,880.00	0.17
94	300759	康龙化成	300	28,566.00	0.16
95	600009	上海机场	500	28,350.00	0.16
96	000063	中兴通讯	1,100	28,083.00	0.16
97	601318	中国平安	600	28,014.00	0.16
98	300316	晶盛机电	400	27,036.00	0.16
99	000538	云南白药	440	26,571.60	0.15
100	600196	复星医药	600	26,454.00	0.15
101	601169	北京银行	5,800	26,332.00	0.15
102	603806	福斯特	400	26,208.00	0.15
103	601229	上海银行	4,000	26,200.00	0.15
104	600050	中国联通	7,500	25,950.00	0.15
105	002791	坚朗五金	200	25,944.00	0.15
106	601766	中国中车	4,900	25,480.00	0.15

107	601628	中国人寿	800	24,864.00	0.14
108	603882	金域医学	300	24,765.00	0.14
109	688008	澜起科技	401	24,292.58	0.14
110	002027	分众传媒	3,600	24,228.00	0.14
111	002311	海大集团	400	24,004.00	0.14
112	601390	中国中铁	3,900	23,946.00	0.14
113	600905	三峡能源	3,800	23,902.00	0.14
114	601669	中国电建	3,000	23,610.00	0.14
115	603260	合盛硅业	200	23,592.00	0.14
116	600570	恒生电子	540	23,511.60	0.13
117	600999	招商证券	1,600	23,056.00	0.13
118	300595	欧普康视	400	22,876.00	0.13
119	002841	视源股份	300	22,596.00	0.13
120	000100	TCL 科技	4,700	22,513.00	0.13
121	601633	长城汽车	600	22,224.00	0.13
122	601877	正泰电器	620	22,183.60	0.13
123	600028	中国石化	5,400	22,032.00	0.13
124	002050	三花智控	800	21,984.00	0.13
125	688396	华润微	368	21,737.76	0.12
126	601985	中国核电	3,100	21,266.00	0.12
127	000338	潍柴动力	1,700	21,199.00	0.12
128	600085	同仁堂	400	21,152.00	0.12
129	301099	雅创电子	251	20,953.48	0.12
130	600010	包钢股份	8,900	20,915.00	0.12
131	601111	中国国航	1,800	20,898.00	0.12
132	601009	南京银行	2,000	20,840.00	0.12
133	600019	宝钢股份	3,400	20,468.00	0.12
134	000895	双汇发展	698	20,451.40	0.12
135	600426	华鲁恒升	700	20,440.00	0.12
136	600958	东方证券	2,000	20,420.00	0.12
137	603369	今世缘	400	20,400.00	0.12
138	601066	中信建投	700	20,237.00	0.12
139	601857	中国石油	3,800	20,140.00	0.12
140	600346	恒力石化	900	20,016.00	0.11
141	300274	阳光电源	200	19,650.00	0.11
142	601818	光大银行	6,500	19,565.00	0.11
143	600588	用友网络	900	19,539.00	0.11
144	600926	杭州银行	1,300	19,474.00	0.11
145	300033	同花顺	200	19,230.00	0.11

146	301215	中汽股份	2,962	18,927.18	0.11
147	600584	长电科技	700	18,900.00	0.11
148	600848	上海临港	1,380	18,712.80	0.11
149	603160	汇顶科技	300	18,579.00	0.11
150	600741	华域汽车	800	18,400.00	0.11
151	000963	华东医药	400	18,064.00	0.10
152	300408	三环集团	600	18,060.00	0.10
153	600845	宝信软件	330	18,018.00	0.10
154	600176	中国巨石	1,016	17,688.56	0.10
155	601021	春秋航空	300	17,505.00	0.10
156	603019	中科曙光	600	17,412.00	0.10
157	603517	绝味食品	300	17,346.00	0.10
158	000786	北新建材	500	17,310.00	0.10
159	603993	洛阳钼业	3,000	17,190.00	0.10
160	601939	建设银行	2,800	16,968.00	0.10
161	002493	荣盛石化	1,100	16,929.00	0.10
162	603899	晨光股份	300	16,824.00	0.10
163	002001	新和成	736	16,788.16	0.10
164	000166	申万宏源	3,900	16,731.00	0.10
165	601138	工业富联	1,700	16,728.00	0.10
166	000425	徐工机械	3,100	16,709.00	0.10
167	600030	中信证券	770	16,678.20	0.10
168	002008	大族激光	500	16,565.00	0.10
169	601006	大秦铁路	2,500	16,475.00	0.09
170	002202	金风科技	1,100	16,280.00	0.09
171	601377	兴业证券	2,300	16,215.00	0.09
172	601336	新华保险	500	16,095.00	0.09
173	603939	益丰药房	300	15,849.00	0.09
174	600011	华能国际	2,200	15,488.00	0.09
175	300529	健帆生物	300	15,267.00	0.09
176	601155	新城控股	600	15,258.00	0.09
177	601238	广汽集团	1,000	15,240.00	0.09
177	601865	福莱特	400	15,240.00	0.09
178	300628	亿联网络	200	15,230.00	0.09
179	603338	浙江鼎力	300	15,210.00	0.09
180	601186	中国铁建	1,900	15,010.00	0.09
181	601838	成都银行	900	14,922.00	0.09
182	301120	新特电气	928	14,857.28	0.09
183	600547	山东黄金	800	14,848.00	0.09

184	301201	诚达药业	207	14,796.36	0.08
185	601600	中国铝业	3,100	14,725.00	0.08
186	600886	国投电力	1,400	14,700.00	0.08
187	603658	安图生物	300	14,667.00	0.08
188	600989	宝丰能源	1,000	14,650.00	0.08
189	600029	南方航空	2,000	14,620.00	0.08
190	300601	康泰生物	320	14,457.60	0.08
191	600079	人福医药	900	14,400.00	0.08
192	603087	甘李药业	300	14,391.00	0.08
193	300676	华大基因	200	14,340.00	0.08
194	002142	宁波银行	400	14,324.00	0.08
195	601788	光大证券	900	14,184.00	0.08
196	301217	铜冠铜箔	948	14,049.36	0.08
197	301235	华康医疗	370	14,023.00	0.08
198	601800	中国交建	1,500	13,920.00	0.08
199	600872	中炬高新	400	13,844.00	0.08
200	688126	沪硅产业	601	13,810.98	0.08
201	002007	华兰生物	600	13,680.00	0.08
202	600383	金地集团	1,000	13,440.00	0.08
203	301117	佳缘科技	247	13,431.86	0.08
204	601995	中金公司	300	13,347.00	0.08
205	300413	芒果超媒	400	13,344.00	0.08
206	300888	稳健医疗	200	13,300.00	0.08
207	300866	安克创新	200	13,264.00	0.08
208	000977	浪潮信息	500	13,240.00	0.08
209	002236	大华股份	800	13,136.00	0.08
210	600015	华夏银行	2,500	13,025.00	0.07
211	002555	三七互娱	600	12,738.00	0.07
212	600332	白云山	400	12,636.00	0.07
213	600115	中国东航	2,300	12,627.00	0.07
214	002568	百润股份	420	12,616.80	0.07
215	301153	中科江南	264	12,328.80	0.07
216	000876	新希望	800	12,240.00	0.07
217	600352	浙江龙盛	1,200	12,216.00	0.07
218	300558	贝达药业	200	12,160.00	0.07
219	301259	艾布鲁	469	12,118.96	0.07
220	000708	中信特钢	600	12,090.00	0.07
221	002938	鹏鼎控股	400	12,084.00	0.07
222	002601	龙佰集团	600	12,030.00	0.07

223	301263	泰恩康	378	11,861.64	0.07
224	301116	益客食品	577	11,793.88	0.07
225	000938	紫光股份	600	11,640.00	0.07
226	003816	中国广核	4,100	11,480.00	0.07
227	601901	方正证券	1,700	11,407.00	0.07
228	601916	浙商银行	3,400	11,288.00	0.06
229	002032	苏泊尔	200	11,268.00	0.06
229	603233	大参林	360	11,268.00	0.06
230	300003	乐普医疗	600	11,142.00	0.06
231	601360	三六零	1,300	11,076.00	0.06
232	601607	上海医药	600	10,848.00	0.06
233	301187	欧圣电气	473	10,831.70	0.06
234	300999	金龙鱼	200	10,804.00	0.06
235	002736	国信证券	1,083	10,364.31	0.06
236	600183	生益科技	600	10,194.00	0.06
237	601966	玲珑轮胎	400	10,148.00	0.06
238	301206	三元生物	219	10,001.73	0.06
239	300433	蓝思科技	900	9,963.00	0.06
240	600918	中泰证券	1,300	9,945.00	0.06
241	600109	国金证券	1,100	9,900.00	0.06
242	301288	清研环境	452	9,889.76	0.06
243	301212	联盛化学	291	9,859.08	0.06
244	000157	中联重科	1,600	9,856.00	0.06
245	601618	中国中冶	2,800	9,800.00	0.06
246	600161	天坛生物	400	9,712.00	0.06
247	600489	中金黄金	1,300	9,607.00	0.06
248	301207	华兰疫苗	168	9,475.20	0.05
249	000703	恒逸石化	900	9,459.00	0.05
250	601108	财通证券	1,200	9,444.00	0.05
251	301256	华融化学	928	9,354.24	0.05
252	601696	中银证券	700	9,310.00	0.05
253	301268	铭利达	261	9,111.51	0.05
254	601878	浙商证券	800	9,104.00	0.05
255	301163	宏德股份	277	9,060.67	0.05
256	301130	西点药业	237	8,927.79	0.05
257	600362	江西铜业	500	8,915.00	0.05
258	002252	上海莱士	1,500	8,895.00	0.05
259	002624	完美世界	600	8,622.00	0.05
260	600143	金发科技	900	8,568.00	0.05

261	002120	韵达股份	500	8,530.00	0.05
262	301236	软通动力	270	8,472.60	0.05
263	301109	军信股份	515	8,353.30	0.05
264	601990	南京证券	1,000	8,340.00	0.05
265	601898	中煤能源	800	8,304.00	0.05
266	000783	长江证券	1,400	8,302.00	0.05
267	002602	世纪华通	1,700	8,194.00	0.05
268	301248	杰创智能	272	8,151.84	0.05
269	002414	高德红外	628	8,082.36	0.05
270	301137	哈焊华通	493	7,883.07	0.05
271	000069	华侨城 A	1,200	7,788.00	0.04
272	301158	德石股份	379	7,716.44	0.04
273	300677	英科医疗	300	7,608.00	0.04
274	000066	中国长城	700	7,574.00	0.04
275	600655	豫园股份	800	7,552.00	0.04
276	600061	国投资本	1,184	7,530.24	0.04
277	301123	奕东电子	295	7,484.15	0.04
278	301150	中一科技	87	7,387.17	0.04
279	601216	君正集团	1,500	7,320.00	0.04
280	301222	浙江恒威	246	7,124.16	0.04
281	301103	何氏眼科	221	7,078.63	0.04
282	301181	标榜股份	231	7,063.98	0.04
283	301216	万凯新材	229	6,833.36	0.04
284	301148	嘉戎技术	284	6,807.48	0.04
285	601881	中国银河	700	6,769.00	0.04
286	601998	中信银行	1,400	6,650.00	0.04
287	601319	中国人保	1,300	6,578.00	0.04
288	301102	兆讯传媒	211	6,559.99	0.04
289	301135	瑞德智能	245	6,441.05	0.04
290	600025	华能水电	900	6,291.00	0.04
291	300834	星辉环材	204	6,122.04	0.04
292	301237	和顺科技	144	6,029.28	0.03
293	002600	领益智造	1,200	6,024.00	0.03
294	600606	绿地控股	1,515	5,999.40	0.03
295	601933	永辉超市	1,400	5,992.00	0.03
296	601231	环旭电子	400	5,744.00	0.03
297	601162	天风证券	1,800	5,724.00	0.03
298	301219	腾远钴业	65	5,710.90	0.03
299	301258	富士莱	136	5,669.84	0.03

300	301279	金道科技	245	5,644.80	0.03
301	601808	中海油服	400	5,580.00	0.03
302	002044	美年健康	1,000	5,570.00	0.03
303	301151	冠龙节能	258	5,547.00	0.03
304	601236	红塔证券	600	5,478.00	0.03
305	688009	中国通号	1,159	5,250.27	0.03
306	301196	唯科科技	136	5,107.92	0.03
307	002064	华峰化学	600	5,064.00	0.03
308	301110	青木股份	110	4,383.50	0.03
309	002157	正邦科技	700	4,242.00	0.02
310	000800	一汽解放	400	3,736.00	0.02
311	002607	中公教育	600	3,474.00	0.02
312	601698	中国卫通	300	3,393.00	0.02

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	000001	平安银行	6,330,456.00	2.77
2	000858	五粮液	4,740,158.00	2.08
3	000776	广发证券	4,015,792.00	1.76
4	002142	宁波银行	3,778,768.00	1.66
5	600519	贵州茅台	3,316,020.00	1.45
6	001979	招商蛇口	2,621,352.00	1.15
7	000002	万科 A	2,443,649.36	1.07
8	002304	洋河股份	2,186,659.00	0.96
9	688981	中芯国际	1,846,735.60	0.81
10	000651	格力电器	1,684,255.00	0.74
11	000568	泸州老窖	1,620,529.00	0.71
12	600938	中国海油	1,296,054.00	0.57
13	300760	迈瑞医疗	1,265,798.00	0.55
14	688599	天合光能	1,129,697.82	0.49
15	601318	中国平安	931,007.00	0.41
16	002466	天齐锂业	778,199.00	0.34
17	600036	招商银行	766,284.00	0.34

18	601012	隆基绿能	717,766.00	0.31
19	300347	泰格医药	598,846.00	0.26
20	300782	卓胜微	584,090.00	0.26

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	000858	五粮液	9,500,378.00	4.16
2	000001	平安银行	9,228,314.00	4.04
3	600519	贵州茅台	8,614,796.00	3.77
4	601318	中国平安	4,528,991.80	1.98
5	600036	招商银行	4,481,042.98	1.96
6	002142	宁波银行	4,023,054.04	1.76
7	000776	广发证券	3,908,645.00	1.71
8	000002	万科 A	3,272,156.00	1.43
9	601012	隆基绿能	3,114,324.99	1.36
10	000651	格力电器	2,880,128.00	1.26
11	001979	招商蛇口	2,794,601.00	1.22
12	002304	洋河股份	2,757,348.44	1.21
13	002025	航天电器	2,728,212.00	1.20
14	000568	泸州老窖	2,606,638.00	1.14
15	601166	兴业银行	2,440,274.00	1.07
16	600900	长江电力	2,417,535.73	1.06
17	600941	中国移动	2,167,776.00	0.95
18	002594	比亚迪	2,074,346.00	0.91
19	000333	美的集团	2,071,894.00	0.91
20	600887	伊利股份	1,983,093.25	0.87

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	77,279,066.37
卖出股票收入（成交）总额	204,955,696.19

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 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

无。

7.12.2 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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规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	106,800.36

2	应收清算款	93,160.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	820.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	200,781.29

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	5,261,873.49	30.19	新股锁定
2	600938	中国海油	1,357,504.64	7.79	新股锁定

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，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
中航混改精选 A	399	2,186.01	686.17	0.08%	871,530.91	99.92%
中航混改精选 C	430	29,392.11	10,826,072.30	85.66%	1,812,537.10	14.34%
合计	829	16,297.74	10,826,758.47	80.13%	2,684,068.01	19.87%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

项目	中航混改精选 A	中航混改精选 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 14 日）基金份额总额	13,392,444.17	295,471,962.36
本报告期期初基金份额总额	883,314.60	158,539,310.06
本报告期基金总申购份额	99,283.84	20,547,767.78
减：本报告期基金总赎回份额	110,381.36	166,448,468.44
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	872,217.08	12,638,609.40

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，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	
中航证券有限公司	2	273,313,551.19	100.00%	199,872.75	100.00%	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	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
中航证券有限公司	222,162,347.90	100.00%	1,207,400,000.00	100.00%	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	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	上海证券报、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	中航混改精选混合型证券投资基金 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
3	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	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022年1月28日
4	关于中航混改精选混合型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022年3月16日

5	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	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 16 日
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	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 18 日
7	中航混改精选混合型证券投资基金 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
8	中航混改精选混合型证券投资基金 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
9	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
10	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	上海证券报、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	66,911,427.30	-	59,400,000.00	7,511,427.30	55.60%
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混改精选混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中航混改精选混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中航混改精选混合型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. 报告期内中航混改精选混合型证券投资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