

# 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证 券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。本年度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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料已经审计。天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.9 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       | 13        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 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 | 14        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 14        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>15</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 15        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 15        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>18</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 18        |
| 7.2 利润表                                 | 19        |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表                        | 20        |
| 7.4 报表附注                                | 23        |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | <b>52</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 52        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 52        |
| 8.3 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        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 52        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 53        |
| 8.6 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      | 53        |
| 8.7 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   | 53        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 8.8 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 ..... | 53        |
| 8.9 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 .....    | 53        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 54        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 54        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 54        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>58</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 58        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 58        |
| 9.3 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 .....     | 58        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>59</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>60</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 60        |
| 11.2 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 .....      | 60        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 60        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 60        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 60        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 60        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 60        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 62        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>65</b> |
| 12.1 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 .....    | 65        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 65        |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                     | <b>66</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 66        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 66        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 66        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 基金名称       | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 |
| 基金简称       | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有        |
| 基金主代码      | 014428                       |
| 交易代码       | 014428                       |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                       |
| 基金合同生效日    | 2021 年 12 月 13 日             |
| 基金管理人      | 中航基金管理有限公司                   |
| 基金托管人      | 上海浦东发展银行股份有限公司               |
| 报告期末基金份额总额 | 741,599,223.97 份             |
| 基金合同存续期    | 不定期                          |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 投资策略   | <p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>1、优化抽样复制策略：本基金通过对标的指数中各成份券的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的成份券构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>2、替代性策略：对于市场流动性不足、因法律法规原因个别成份券被限制投资等情况，本基金无法获得对个别成份券足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份券、非成份券等方式进行替代。</p> <p>3、债券投资策略。</p> <p>4、资产支持证券投资策略。</p> <p>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定并履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单 AAA 指数收益率*95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)*5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 风险收益特征 | 本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

## 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                                   | 上海浦东发展银行股份有限公司     |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 武国强                                          | 朱萍                 |
|         | 联系电话 | 010-56716188                                 | 021-61618888       |
|         | 电子邮箱 | wuguoqiang@avicfund.cn                       | zhup02@spdb.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-666-2186                                 | 95528              |
| 传真      |      | 010-56716198                                 | 021-63602540       |
| 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  | 上海市中山东一路 12 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 | 上海市北京东路 689 号      |
| 邮政编码    |      | 100101                                       | 200001             |
| 法定代表人   |      | 杨彦伟                                          | 郑杨                 |

## 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》         |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.avicfund.cn |
| 基金年度报告备置地点          | 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                                         |
|--------|--------------------|----------------------------------------------|
| 会计师事务所 | 天职国际会计师事务所(特殊普通合伙) | 北京海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼                 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2022 年         | 2021 年 12 月 13 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|--------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 28,728,131.10  | 766,542.50                                 |
| 本期利润          | 27,229,791.93  | 1,086,022.50                               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0192         | 0.0017                                     |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.90%          | 0.17%                                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.89%          | 0.17%                                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末        | 2021 年末                                    |
| 期末可供分配利润      | 15,240,909.69  | 766,542.50                                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0206         | 0.0012                                     |
| 期末基金资产净值      | 756,840,133.66 | 644,633,749.94                             |
| 期末基金份额净值      | 1.0206         | 1.0017                                     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2022 年末        | 2021 年末                                    |
| 基金份额累计净值增长率   | 2.06%          | 0.17%                                      |

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。

④本基金基金合同于 2021 年 12 月 13 日生效，上年度为不完整会计区间。

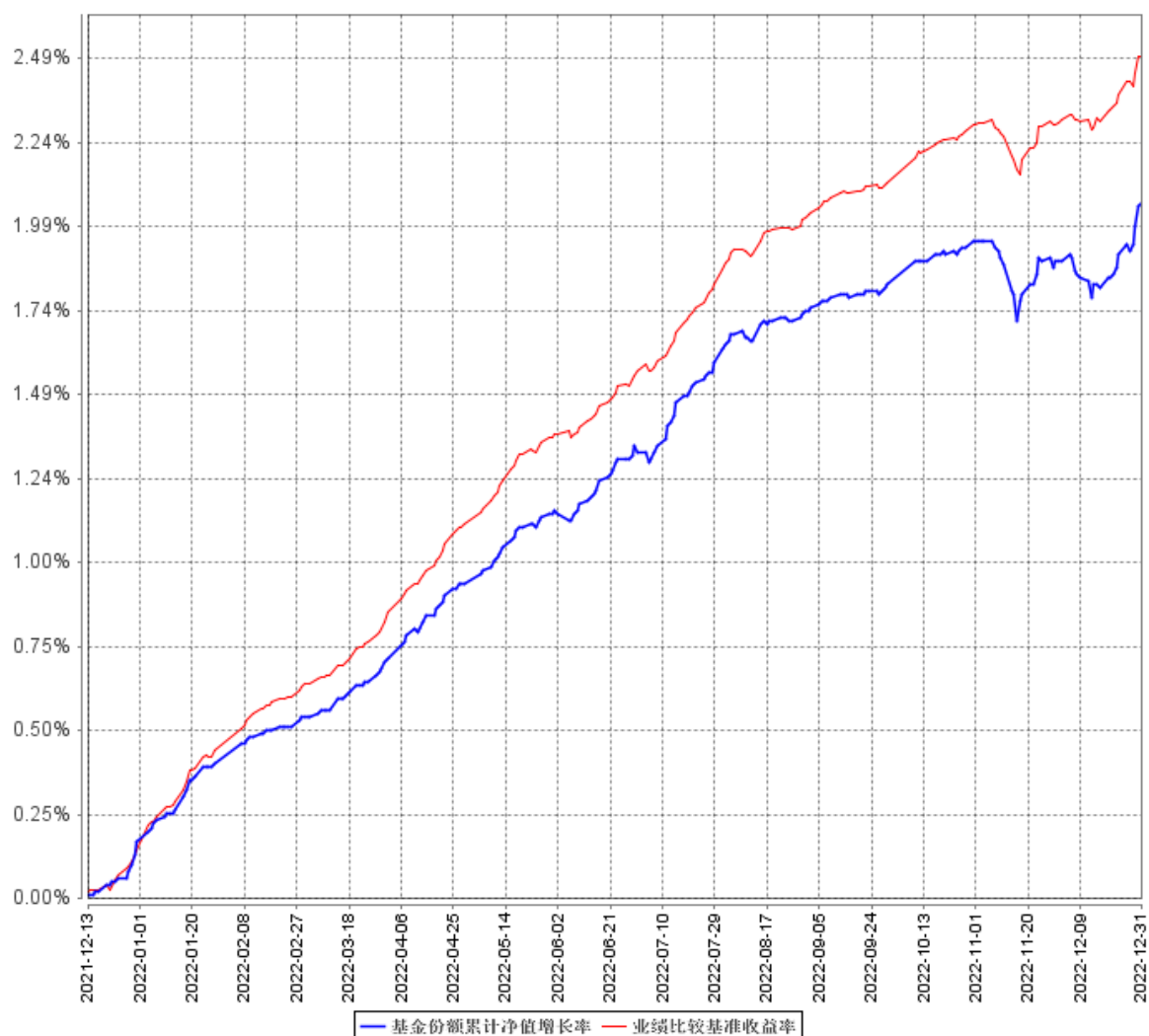
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.24%    | 0.03%       | 0.37%      | 0.02%         | -0.13% | 0.01% |
| 过去六个月      | 0.71%    | 0.02%       | 0.93%      | 0.02%         | -0.22% | 0.00% |
| 过去一年       | 1.89%    | 0.02%       | 2.35%      | 0.01%         | -0.46% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.06%    | 0.02%       | 2.49%      | 0.01%         | -0.43% | 0.01% |

### 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

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

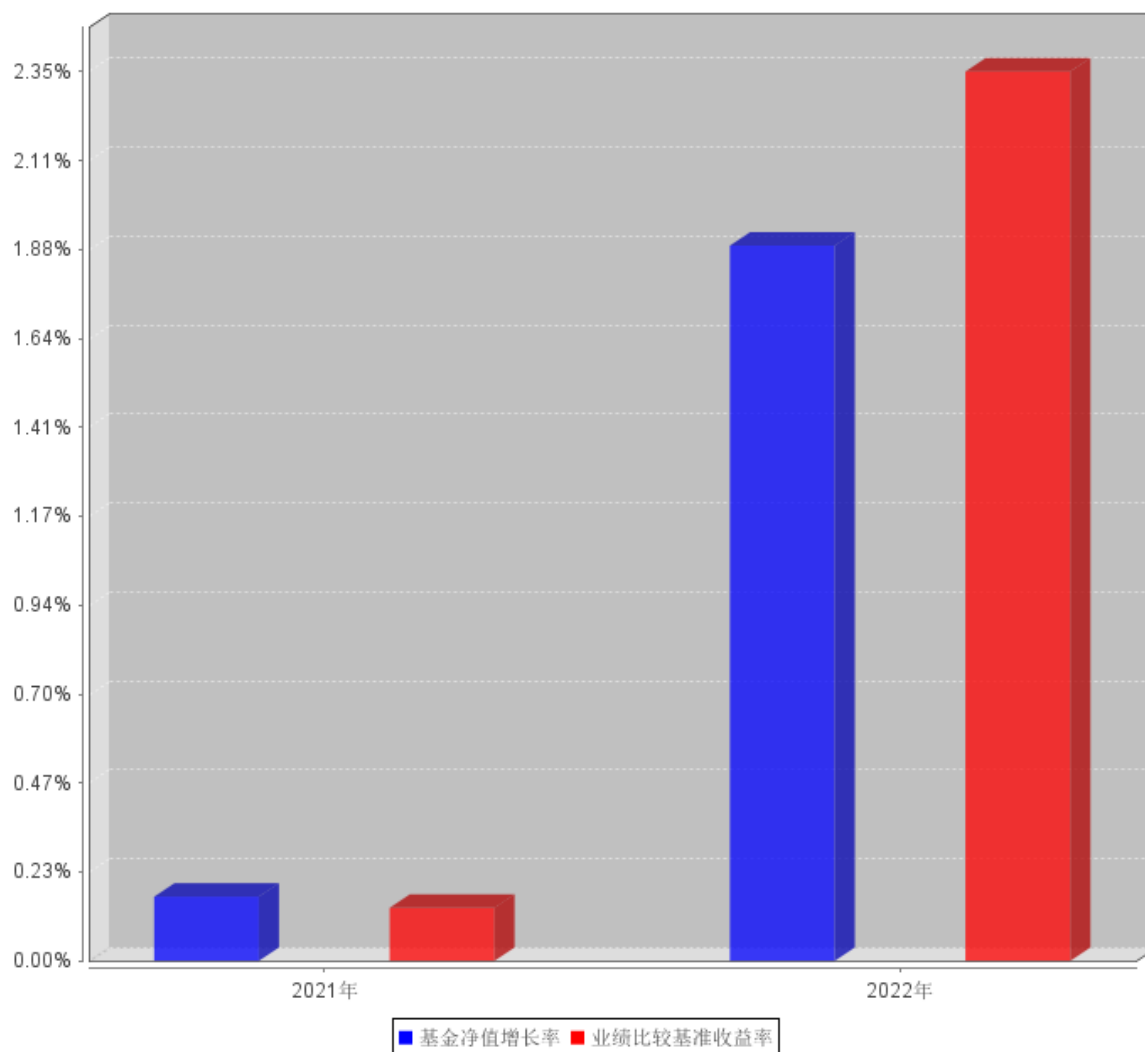


注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关规定。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效日（2021 年 12 月 13 日）至报告期截止日（2022 年 12 月 31 日）未进行利润分配。

## § 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中国基金管理人公司。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 | 2021 年 12 月 13 日 | —    | 4      | 硕士研究生。曾供职于中核财务有限责任公司先后担任稽核风险管理部风险管理岗、金融市场部投资分析岗、金融市场部副经理兼投资经理岗。2017 年 8 月至今，担任中航基金管理有限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》、《中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

## 4.4 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，债市的主线围绕预期与现实之间的差异，主要矛盾聚焦在疫情的管控与资金面的博弈，我们经历了长时间的偏低利率环境和资产荒，也经历了理财赎回带来的恐慌抛售。全年看，债券收益率整体维持震荡，短端和超长端表现较好。全年经济数据受疫情因素影响较大，制造业和服务业 PMI 数据经历了下行、企稳到再次探底。全年央行开展了两次降息和两次降准操作，货币市场操作稳健，货币政策仍是稳中有松，给与市场充分预期管理，全年通胀压力不大。地产行业给信用债市场带来的负面效应边际减弱，地产扶持政策密集出台，地产债企稳迹象明显，中高等级产业债和城投债表现相对稳健，弱资质城投承压。2022 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，市场对加息预期已经反应的比较充分，经济韧性仍在，欧洲经济承压。2022 年债市整体表现差强人意，市场上存单指数基金整体表现良好，“以我为主”的货币政策进一步证实，央行对债市呵护积极。

2022 年，本组合作为指数型基金主要投资于流动性好的 AAA 存单，紧密跟踪中证同业存单 AAA 指数，小部分资产投资于利率债和高等级信用债，组合久期跟随指数，杠杆水平较低。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金份额净值为 1.0206，本报告期基金份额净值增长率为 1.89%，同期业绩比较基准收益率为 2.35%。

#### 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 2023 年，预计我国稳健的货币政策仍将持续，海外经济和通胀预期对国内政策扰动有限，地产风险已经暴露比较充分，经济触底反弹是大概率事件，但是复苏节奏仍有待考量，资金面大概率收敛而不收紧，本组合在 2023 年将继续维持较低水平杠杆，密切跟踪指数。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况，以维护基金份额持有人利益为宗旨，组织开展内部监察稽核，完善合规与内控机制，积极推动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，有效保证了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。本报告期内，本基金管理人开展的主要监察稽核工作如下：

（1）积极推动监管新规落实，持续完善公司内控机制。结合新规实施和公司业务发展实际，不断推动公司制度、业务流程的建立、健全和完善，以适应公司产品与业务创新发展的需要；

（2）在公司开展新产品设计、新业务过程中，就相关问题提供合规咨询，出具合规审查意见。全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促完善投资者适当性管理；

（3）有计划、有重点地对投资、研究、交易、销售、公司治理、信息技术、反洗钱等业务领域开展定期及专项监察检查，不断查缺补漏，持续提高内部控制的有效性和风险防控能力，保障公司业务合规、持续、健康、稳定发展；

（4）持续推动建立与行业和公司业务相匹配的洗钱风险管理机制，检查洗钱风险与控制措施的有效性，进一步完善与风险能力相适应的反洗钱制度、流程，完善反洗钱系统建设，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，同时，做好反洗钱宣传培训、监督检查、信息报送等各项工作；

（5）加强合规宣导培训，不断推动公司合规文化建设。通过“面授+线上”等多种形式，有

针对性地开展了投资者个人信息保护、基金宣传推介、反洗钱、新员工入职等合规宣导与合规培训工作，并通过新规动态、合规专题、合规风险案例等多种方式进行合规宣导，提升员工的合规风险意识，强化全员合规、主动合规理念。

本基金管理人承诺将坚持诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中航基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                 |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见           |
| 审计报告编号     | 天职业字[2023]17319 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题    | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 审计报告收件人   | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金全体持有人                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 审计意见      | <p>我们审计了中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(以下简称“中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金”)财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表、2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制。公允反映了中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>                                                 |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>                                                                                                                                   |
| 强调事项      | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 其他事项      | <p>中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金财务报表仅为满足中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会的监管需要之目的而编制。因此,该财务报表可能不适用于其他用途。我们的报告仅用于供中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金管理人报送中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会使用,而不应分发至除中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金持有人、中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会以外的其他机构或人员或为其使用。</p> <p>本段内容不影响已发表的审计意见。</p>                        |
| 其他信息      | <p>中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金管理人中航基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p> |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</li> <li>2. 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</li> <li>3. 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</li> <li>4. 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得</li> </ol> |



|           |                                                                                                                                                                                                                                                                              |     |
|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | <p>出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金不能持续经营。</p> <p>5. 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称 | 天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                           |     |
| 注册会计师的姓名  | 丁启新                                                                                                                                                                                                                                                                          | 周任阳 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼                                                                                                                                                                                                                                                |     |
| 审计报告日期    | 2023 年 3 月 28 日                                                                                                                                                                                                                                                              |     |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 银行存款          | 7.4.7.1    | 4,574,288.21                    | 22,913,016.49                    |
| 结算备付金         |            | -                               | -                                |
| 存出保证金         |            | -                               | -                                |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 781,181,581.99                  | 370,086,000.00                   |
| 其中：股票投资       |            | -                               | -                                |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 781,181,581.99                  | 370,086,000.00                   |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                               | 249,935,694.90                   |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                               | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | -                               | -                                |
| 应收清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | 21,507,390.17                   | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                               | 1,850,509.59                     |
| 资产总计          |            | 807,263,260.37                  | 644,785,220.98                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                 |                                  |
| 短期借款          |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | 50,047,676.94                   | -                                |
| 应付清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                               | -                                |

|             |          |                |                |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬     |          | 132,802.81     | 63,503.76      |
| 应付托管费       |          | 33,200.71      | 15,875.91      |
| 应付销售服务费     |          | 132,802.81     | 63,503.76      |
| 应付投资顾问费     |          | -              | -              |
| 应交税费        |          | 10,719.30      | -              |
| 应付利润        |          | -              | -              |
| 递延所得税负债     |          | -              | -              |
| 其他负债        | 7.4.7.9  | 65,924.14      | 8,587.61       |
| 负债合计        |          | 50,423,126.71  | 151,471.04     |
| <b>净资产：</b> |          |                |                |
| 实收基金        | 7.4.7.10 | 741,599,223.97 | 643,547,727.44 |
| 其他综合收益      | 7.4.7.11 | -              | -              |
| 未分配利润       | 7.4.7.12 | 15,240,909.69  | 1,086,022.50   |
| 净资产合计       |          | 756,840,133.66 | 644,633,749.94 |
| 负债和净资产总计    |          | 807,263,260.37 | 644,785,220.98 |

注：①报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 741,599,223.97 份，基金份额净值 1.0206 元。

②本基金基金合同于 2021 年 12 月 13 日生效，上年度为不完整会计年度，下同。

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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目        | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 12 月 13 日(基<br>金合同生效日)至<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|----------|-------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|
| 一、营业总收入    |          | 35,163,732.67                             | 1,237,198.64                                                  |
| 1. 利息收入    |          | 2,330,966.48                              | 917,718.64                                                    |
| 其中：存款利息收入  | 7.4.7.13 | 14,273.42                                 | 558,432.44                                                    |
| 债券利息收入     |          | -                                         | 140,562.20                                                    |
| 资产支持证券利息收入 |          | -                                         | -                                                             |
| 买入返售金融资产收入 |          | 2,316,693.06                              | 218,724.00                                                    |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 证券出借利息收入                   |            | -             | -            |
| 其他利息收入                     |            | -             | -            |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 34,331,105.36 | -            |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.14   | -             | -            |
| 基金投资收益                     |            | -             | -            |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.15   | 34,331,105.36 | -            |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.16   | -             | -            |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.17   | -             | -            |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.18   | -             | -            |
| 股利收益                       | 7.4.7.19   | -             | -            |
| 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）     | 7.4.7.20   | -1,498,339.17 | 319,480.00   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -             | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.21   | -             | -            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 7,933,940.74  | 151,176.14   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 2,861,021.35  | 63,503.76    |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 715,255.38    | 15,875.91    |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 2,861,021.35  | 63,503.76    |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 1,252,003.50  | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 1,252,003.50  | -            |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.22   | -             | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 20,690.51     | -            |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 223,948.65    | 8,292.71     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 27,229,791.93 | 1,086,022.50 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 27,229,791.93 | 1,086,022.50 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 27,229,791.93 | 1,086,022.50 |

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                           | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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)                              | 643,547,727.44                                         | -      | 1,086,022.50    | 644,633,749.94     |
| 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)                              | 643,547,727.44                                         | -      | 1,086,022.50    | 644,633,749.94     |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                         | 98,051,496.53                                          | -      | 14,154,887.19   | 112,206,383.72     |
| (一)、综合收益总额                                   | -                                                      | -      | 27,229,791.93   | 27,229,791.93      |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)      | 98,051,496.53                                          | -      | -13,074,904.74  | 84,976,591.79      |
| 其中：1.基金申购款                                   | 14,782,474,360.78                                      | -      | 142,337,032.53  | 14,924,811,393.31  |
| 2.基金赎回款                                      | -14,684,422,864.25                                     | -      | -155,411,937.27 | -14,839,834,801.52 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动<br>(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)                              | 741,599,223.97                                         | -      | 15,240,909.69   | 756,840,133.66     |
| 项目                                           | 上年度可比期间<br>2021 年 12 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 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)                          | -              | -      | -            | -              |
| 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)                          | 643,547,727.44 | -      | -            | 643,547,727.44 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -              | -      | 1,086,022.50 | 1,086,022.50   |
| (一)、综合收益总额                               | -              | -      | 1,086,022.50 | 1,086,022.50   |
| (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)      | -              | -      | -            | -              |
| 其中：1.基金申购款                               | -              | -      | -            | -              |
| 2.基金赎回款                                  | -              | -      | -            | -              |
| (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)                          | 643,547,727.44 | -      | 1,086,022.50 | 644,633,749.94 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
刘建

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
裴荣荣

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
韩丹

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（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[2021]3720 号文《关于准予中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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《中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 2021 年 12 月 13 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，基金合同生效日总计确认的净认购金额为 643,467,896.83 元，实收基金份额为 643,547,727.44 份。确认的有效认购金额 643,467,896.83 元，实收基金份额为 643,547,727.44 份（含利息转份额 79,830.61 份）。本基金募集资金经天职会计师事务所（特殊普通合伙）验资验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府支持债券、政府支持机构债券等）、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、现金等货币市场工具等，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的相关规定）。

本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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。

### 7.4.2 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”）、中国证券投资基金业协会制定的《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 2 号—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—年度报告和中期报告》、《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。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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业务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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、同业存单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。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项,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:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。基金持有的其他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。

### 7.4.4.4 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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费

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。

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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由各兑付机构扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，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。

#### **7.4.4.10 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。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人届时发布的相关分红公告，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期，按原份额的持有期计算；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于调整实施日前在规定媒介上公告。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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 22,913,016.49 元、买入返售金融资产金额 249,935,694.90 元、应收利息金额 1,850,509.59 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 23,128,223.48 元、买入返售金融资产金额 250,154,418.90 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 370,086,000.00 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 371,502,578.60 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 3,144.90 元、其他负债金额 5,442.71 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 8,587.61 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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；
8. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 4,574,288.21            | 22,913,016.49            |
| 等于：本金          | 4,574,069.58            | 22,913,016.49            |
| 加：应计利息         | 218.63                  | —                        |
| 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：         | 4,574,288.21 | 22,913,016.49 |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日  |              |                |               |
|---------------|-------|--------------------------|--------------|----------------|---------------|
|               |       | 成本                       | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | -                        | -            | -              | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -            | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | -                        | -            | -              | -             |
|               | 银行间市场 | 774,367,259.17           | 7,993,181.99 | 781,181,581.99 | -1,178,859.17 |
|               | 合计    | 774,367,259.17           | 7,993,181.99 | 781,181,581.99 | -1,178,859.17 |
| 资产支持证券        |       | -                        | -            | -              | -             |
| 基金            |       | -                        | -            | -              | -             |
| 其他            |       | -                        | -            | -              | -             |
| 合计            |       | 774,367,259.17           | 7,993,181.99 | 781,181,581.99 | -1,178,859.17 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |              |                |               |
|               |       | 成本                       | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | -                        | -            | -              | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -            | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | -                        | -            | -              | -             |
|               | 银行间市场 | 369,766,520.00           | -            | 370,086,000.00 | 319,480.00    |
|               | 合计    | 369,766,520.00           | -            | 370,086,000.00 | 319,480.00    |
| 资产支持证券        |       | -                        | -            | -              | -             |
| 基金            |       | -                        | -            | -              | -             |
| 其他            |       | -                        | -            | -              | -             |
| 合计            |       | 369,766,520.00           | -            | 370,086,000.00 | 319,480.00    |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

**7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

本报告期末及上年度末，本基金未持有期货合约。

**7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

本报告期末及上年度末，本基金未持有黄金衍生品。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | —                        | —         |
| 银行间市场 | —                        | —         |
| 合计    | —                        | —         |
| 项目    | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | —                        | —         |
| 银行间市场 | 249,935,694.90           | —         |
| 合计    | 249,935,694.90           | —         |

注：本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本报告期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.4.3 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。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

本报告期末及上年度末，本基金未持有债权投资。

**7.4.7.5.2 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。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他债权投资。

**7.4.7.6.2 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。

### 7.4.7.7 其他权益工具投资

#### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
| 应收利息  | —                       | 1,850,509.59             |
| 其他应收款 | —                       | —                        |
| 待摊费用  | —                       | —                        |
| 合计    | —                       | 1,850,509.59             |

注：本报告期末本基金未持有其他资产。

### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 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      | 26,924.14               | 3,144.90                 |
| 其中：交易所市场    | —                       | —                        |
| 银行间市场       | 26,924.14               | 3,144.90                 |
| —           | —                       | —                        |
| 应付利息        | —                       | —                        |
| 预提费用        | 39,000.00               | 5,442.71                 |
| 合计          | 65,924.14               | 8,587.61                 |

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和银行间债券账户维护费。

### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |                    |
|---------------|----------------------------------------|--------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额               |
| 上年度末          | 643,547,727.44                         | 643,547,727.44     |
| 本期申购          | 14,782,474,360.78                      | 14,782,474,360.78  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -14,684,422,864.25                     | -14,684,422,864.25 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| — 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           | 741,599,223.97 | 741,599,223.97 |

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。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分         | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 本期期初           | 766,542.50      | 319,480.00    | 1,086,022.50    |
| 本期利润           | 28,728,131.10   | -1,498,339.17 | 27,229,791.93   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -13,545,642.38  | 470,737.64    | -13,074,904.74  |
| 其中：基金申购款       | 132,381,431.43  | 9,955,601.10  | 142,337,032.53  |
| 基金赎回款          | -145,927,073.81 | -9,484,863.46 | -155,411,937.27 |
| 本期已分配利润        | —               | —             | —               |
| 本期末            | 15,949,031.22   | -708,121.53   | 15,240,909.69   |

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 12 月 13 日(基金合同生效<br>日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,273.42                                 | 558,432.44                                                 |
| 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 | —                                         | —                                                          |
| 其他        | —                                         | —                                                          |
| 合计        | 14,273.42                                 | 558,432.44                                                 |

**7.4.7.14 股票投资收益****7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成**

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益。

**7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益——买卖股票差价收入。

**7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

**7.4.7.15 债券投资收益****7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年12月13日(基金<br>合同生效日)至2021年12月<br>31日 |
|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                  | 35,084,411.26                   | -                                                   |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -753,305.90                     | -                                                   |
| 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                            | 34,331,105.36                   | -                                                   |

**7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年12月13日(基金<br>合同生效日)至2021年12月<br>31日 |
|-------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 8,121,027,332.29                | -                                                   |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 8,005,780,677.54                | -                                                   |
| 减：应计利息总额                | 115,908,540.65                  | -                                                   |
| 减：交易费用                  | 91,420.00                       | -                                                   |
| 买卖债券差价收入                | -753,305.90                     | -                                                   |

**7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.16 资产支持证券投资收益****7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本报告期及上年度可比期间，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。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.19 股利收益**

本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------|----|---------|
|------|----|---------|

|                        | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 2021 年 12 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------------------------------|---------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -1,498,339.17                    | 319,480.00                                  |
| ——股票投资                 | -                                | -                                           |
| ——债券投资                 | -1,498,339.17                    | 319,480.00                                  |
| ——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                     | -1,498,339.17                    | 319,480.00                                  |

#### 7.4.7.21 其他收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本报告期及上年度可比期间，本基金无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 12 月 13 日(基金合同<br>生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| 审计费用    | 30,000.00                                 | -                                                          |
| 信息披露费   | 104,557.29                                | 5,442.71                                                   |
| 证券出借违约金 | -                                         | -                                                          |
| 银行划款费   | 52,291.36                                 | 400.00                                                     |
| 账户维护费   | 36,900.00                                 | -                                                          |
| 开户费     | 200.00                                    | -                                                          |
| 交易费用    | -                                         | 2,450.00                                                   |
| 合计      | 223,948.65                                | 8,292.71                                                   |

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 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        |
| 北京首钢基金有限公司     | 基金管理人股东               |

### 7.4.10 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。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.3 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。

##### 7.4.10.1.4 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。

##### 7.4.10.1.5 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 12 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|--------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,861,021.35                           | 63,503.76                                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,118,958.51                           | —                                                      |

注：①本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：



$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

②基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 12 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|--------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 715,255.38                             | 15,875.91                                              |

注：①本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

②基金托管费每日计提，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日                 |
|-------------------|--------------------------------------------------------|
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                       |
| 上海浦东发展银行股份有限公司    | 128,660.41                                             |
| 中航基金管理有限公司        | 200,260.60                                             |
| 中航证券有限公司          | 584,873.93                                             |
| 合计                | 913,794.94                                             |
| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021 年 12 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                       |
| 上海浦东发展银行股份有限公司    | 1,621.98                                               |

|            |           |
|------------|-----------|
| 中航基金管理有限公司 | 16,978.78 |
| 中航证券有限公司   | 39,058.76 |
| 合计         | 57,659.52 |

注：①本基金的销售服务费年费率为 0.20%。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

②销售服务费计提，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内从基金财产中一次性划付到由基金管理人开立的 TA 清算账户中，基金管理人根据与销售机构签订的代销协议中约定的付款周期分别划付给销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日                 |        |      |       |      |                |           |
|--------------------------------------------------------|--------|------|-------|------|----------------|-----------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                                         | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购          |           |
|                                                        | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出      |
| 上海浦东发展银行股份有限公司                                         | -      | -    | -     | -    | 300,000,000.00 | 28,767.12 |
| 上年度可比期间<br>2021 年 12 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |        |      |       |      |                |           |
| 银行间市场交易的各关联方名称                                         | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购          |           |
|                                                        | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出      |
| -                                                      | -      | -    | -     | -    | -              | -         |

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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。

##### 7.4.10.5.3 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2021 年 12 月 13 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |            |
|----------------|----------------------------------------|-----------|--------------------------------------------------------|------------|
|                | 期末余额                                   | 当期利息收入    | 期末余额                                                   | 当期利息收入     |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 4,574,288.21                           | 14,273.42 | 22,913,016.49                                          | 558,432.44 |

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 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。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 50,047,676.94 元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量(张)   | 期末估值总额        |
|-----------|---------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 112206067 | 22 交通银行 CD067 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.69  | 56,000  | 5,582,640.00  |
| 112215470 | 22 民生银行 CD470 | 2023 年 1 月 3 日 | 97.94  | 500,000 | 48,970,000.00 |
| 合计        |               |                |        | 556,000 | 54,552,640.00 |

#### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金的风险和预期收益低于股票型基金,高于货币基金,属于证券投资基金中的中低风险/收益品种。本基金投资的金融工具主要为同业存单、债券等固定收益品种。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。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

董事会对公司风险管理负有最终责任,董事会下设合规及风险管理委员会与督察长。合规及风险管理委员会主要负责审核和指导公司的风险管理政策,对公司的整体风险水平、风险控制措施的实施情况进行评价。督察长负责组织指导公司监察稽核工作,监督检查受托资产和公司运作

的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

经营管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，经营管理层下设风险控制委员会。风险控制委员会主要负责审议风险管理制度和流程，处置重大风险事件，促进风险管理文化的形成。

监察稽核部和风险管理部是公司内部控制的职能部门。各职能部门负责从经营管理的各环节上贯彻落实风险管理措施，执行风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告等风险管理程序，并持续完善相应的内部控制制度和流程。

#### 7.4.13.2 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(上年度末：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。

##### 7.4.13.2.1 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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 60,320,856.89           | -                        |
| 合计     | 60,320,856.89           | -                        |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中未评级债券主要包含国债、政策性金融债、短期融资券等。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

**7.4.13.2.3 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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | —                       | —                        |
| A-1 以下 | —                       | —                        |
| 未评级    | 649,744,817.16          | 370,086,000.00           |
| 合计     | 649,744,817.16          | 370,086,000.00           |

**7.4.13.2.4 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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 71,115,907.94           | —                        |
| AAA 以下 | —                       | —                        |
| 未评级    | —                       | —                        |
| 合计     | 71,115,907.94           | —                        |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

**7.4.13.3 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。

#### **7.4.13.3.1 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

#### **7.4.13.3.2 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公司的证券不得超过该证券的 10%。

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，且基金开放退出期间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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、债券及同业存单投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022<br>年 12<br>月 31<br>日 | 1 个月以内        | 1-3 个月        | 3 个月-1 年       | 1-5<br>年 | 5<br>年<br>以上 | 不计息           | 合计             |
|----------------------------------|---------------|---------------|----------------|----------|--------------|---------------|----------------|
| 资产                               |               |               |                |          |              |               |                |
| 银行存款                             | 4,574,288.21  | -             | -              | -        | -            | -             | 4,574,288.21   |
| 交易性金融资产                          | 80,303,136.56 | 69,796,041.21 | 631,082,404.22 | -        | -            | -             | 781,181,581.99 |
| 应收申购款                            | -             | -             | -              | -        | -            | 21,507,390.17 | 21,507,390.17  |
| 资产总计                             | 84,877,424.77 | 69,796,041.21 | 631,082,404.22 | -        | -            | 21,507,390.17 | 807,263,260.37 |
| 负债                               |               |               |                |          |              |               |                |
| 卖出回购金融资产款                        | 50,047,676.94 | -             | -              | -        | -            | -             | 50,047,676.94  |
| 应付管理人报                           | -             | -             | -              | -        | -            | 132,802.81    | 132,802.81     |



|                                       |                |               |                 |       |       |               |                 |
|---------------------------------------|----------------|---------------|-----------------|-------|-------|---------------|-----------------|
| 酬                                     |                |               |                 |       |       |               |                 |
| 应付<br>托管<br>费                         |                | -             | -               | -     | -     | 33,200.71     | 33,200.71       |
| 应付<br>销售<br>服务<br>费                   |                | -             | -               | -     | -     | 132,802.81    | 132,802.81      |
| 应交<br>税费                              |                | -             | -               | -     | -     | 10,719.30     | 10,719.30       |
| 其他<br>负债                              |                | -             | -               | -     | -     | 65,924.14     | 65,924.14       |
| 负债<br>总计                              | 50,047,676.94  | -             | -               | -     | -     | 375,449.77    | 50,423,126.71   |
| 利率<br>敏感<br>度缺<br>口                   | 34,829,747.83  | 69,796,041.21 | 631,082,404.22  | -     | -     | 21,131,940.40 | 756,840,133.66  |
| 上年<br>度末<br>2021<br>年 12<br>月 31<br>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<br>存款                              | 22,913,016.49  | -             | -               | -     | -     | -             | 22,913,016.49   |
| 交易<br>性金<br>融资<br>产                   | -              | -             | -370,086,000.00 | -     | -     | -             | -370,086,000.00 |
| 买入<br>返售<br>金融<br>资产                  | 249,935,694.90 | -             | -               | -     | -     | -             | -249,935,694.90 |
| 其他<br>资产                              | -              | -             | -               | -     | -     | 1,850,509.59  | 1,850,509.59    |
| 资产<br>总计                              | 272,848,711.39 | -             | -370,086,000.00 | -     | -     | 1,850,509.59  | 644,785,220.98  |
| 负债                                    |                |               |                 |       |       |               |                 |
| 应付<br>管理<br>人报<br>酬                   | -              | -             | -               | -     | -     | 63,503.76     | 63,503.76       |

|         |                |                 |   |   |              |                |
|---------|----------------|-----------------|---|---|--------------|----------------|
| 应付托管费   | -              | -               | - | - | 15,875.91    | 15,875.91      |
| 应付销售服务费 | -              | -               | - | - | 63,503.76    | 63,503.76      |
| 其他负债    | -              | -               | - | - | 8,587.61     | 8,587.61       |
| 负债总计    | -              | -               | - | - | 151,471.04   | 151,471.04     |
| 利率敏感度缺口 | 272,848,711.39 | -370,086,000.00 | - | - | 1,699,038.55 | 644,633,749.94 |

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 年年度报告资产负债表中“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”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

#### 7.4.13.4.1.2 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2022 年 12 月 31 日）           | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -938,260.32                     | -791,877.01            |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 941,206.77                      | 795,291.07             |

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 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，未持有权益类证券及贵金属投资、权证投资等，因此无重大其他价格风险敞口。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金无其他价格风险敞口。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | —                       | —                        |
| 第二层次          | 781,181,581.99          | 370,086,000.00           |
| 第三层次          | —                       | —                        |
| 合计            | 781,181,581.99          | 370,086,000.00           |

##### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 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。

### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | —              | —                |
|    | 其中：股票             | —              | —                |
| 2  | 基金投资              | —              | —                |
| 3  | 固定收益投资            | 781,181,581.99 | 96.77            |
|    | 其中：债券             | 781,181,581.99 | 96.77            |
|    | 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      | 4,574,288.21   | 0.57             |
| 8  | 其他各项资产            | 21,507,390.17  | 2.66             |
| 9  | 合计                | 807,263,260.37 | 100.00           |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有境内股票。

#### 8.2.2 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。

### 8.3 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

本报告期末本基金未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

本报告期本基金未买入股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本报告期本基金未卖出股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本报告期本基金未买卖股票。

**8.5 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      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 39,963,964.84  | 5.28         |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | —              | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —              | —            |
| 4  | 企业债券      | —              | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | 20,356,892.05  | 2.69         |
| 6  | 中期票据      | 71,115,907.94  | 9.40         |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | 649,744,817.16 | 85.85        |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 781,181,581.99 | 103.22       |

**8.6 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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 112292351 | 22 广州农村商业银行 CD017 | 500,000 | 49,862,600.14 | 6.59         |
| 2  | 112296440 | 22 南京银行 CD058     | 500,000 | 49,712,269.86 | 6.57         |
| 3  | 112283927 | 22 徽商银行 CD074     | 500,000 | 49,623,749.82 | 6.56         |
| 4  | 112219225 | 22 恒丰银行 CD225     | 500,000 | 49,394,874.79 | 6.53         |
| 5  | 112285981 | 22 青岛银行 CD054     | 500,000 | 49,196,586.85 | 6.50         |

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

22 广州农村商业银行 CD017（代码：112292351）

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

2022 年 1 月 28 日，中国银保监会广东监管局对广州农村商业银行对非保本同业理财产品出具保本保收益承诺、虚假转让非标债权资产，罚款 100 万元。

22 徽商银行 CD074（代码：112283927）

2022 年 5 月 6 日，中国人民银行合肥中心支行对徽商银行单位银行结算账户未向或未在规定时间内向人民币结算账户管理系统备案；单位银行结算账户未经人民银行核准；个人银行结算账户未向或未在规定时间内向账户管理系统备案；单位商户使用个人银行账户作为收单结算账户，警告，并处罚款人民币 9 万元。

22 恒丰银行 CD225（代码：112219225）

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对恒丰银行漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报贷款核销业务 EAST 数据；错报债券投资业务 EAST 数据；未报送权益类投资业务 EAST 数据；未报送私募基金投资业务 EAST 数据；未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；漏报跟单信用证业务 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 系统分户账与总账比对不一致；漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；未开户当月向 EAST 系统报送账户信息；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《个人活期存款分户账明细记录》表错报；EAST 系统《个人信贷业

务借据》表错报，罚款 480 万元。

2022 年 5 月 25 日，国家外汇管理局山东省分局对恒丰银行违反规定办理结汇；未按照规定报送结售汇综合头寸报表，责令改正，给予警告，处罚款 71 万元人民币，没收违法所得 24.39 万元人民币，罚没款合计 95.39 万元人民币。

2022 年 4 月 28 日，中国银行间市场交易商协会对恒丰银行作为山东胜通集团股份有限公司相关债务融资工具主承销商，在“17 胜通 MTN001”“17 胜通 MTN002”尽职调查过程中，未就涉及山东胜通第一大主营业务的异常情况保持合理怀疑并进行充分核查，未对山东胜通子公司山东胜通化工有限公司进行实地调查、进而未能发现该子公司已经停产的事实，尽职调查个别环节未规范开展，对恒丰银行予以警告；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。

#### 22 上海银行 CD162（代码：112216162）

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。

#### 22 宁波银行 CD276（代码：112287934）

2022 年 5 月 27 日，宁波银保监局对宁波银行非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位、违规办理衍生产品交易业务、信用证议付资金用于购买本行理财、违规办理委托贷款业务、非银融资业务开展不规范、内控管理不到位、数据治理存在欠缺，罚款人民币 290 万元。

2022 年 4 月 21 日，宁波银保监局对宁波银行薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位、授信管理不审慎、资金用途管控不严、贷款风险分类不准确、票据业务管控不严、非现场统计数据差错，罚款人民币 270 万元。

2022 年 4 月 11 日，宁波银保监局对宁波银行信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位，罚款人民币 220 万元。

2022 年 4 月 11 日，宁波银保监局对宁波银行代理保险销售不规范，罚款人民币 30 万元。

#### 22 光大银行 CD185（代码：112217185）

2022 年 5 月 24 日，中国银行保险监督管理委员会对光大银行老产品规模在部分时点出现反弹；托管机构未及时发现理财产品集中度超标；托管业务违反资产独立性要求，操作管理不到位，

罚款 400 万元。

2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对光大银行逾期 90 天以上贷款余额 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；漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；漏报权益类投资业务 EAST 数据；未报送其他担保类业务 EAST 数据；漏报委托贷款业务 EAST 数据；EAST 系统理财产品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；漏报对公活期存款账户明细 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《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；2018 年行政处罚问题依然存在，罚款 490 万元。

2022 年 1 月 19 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对光大银行违反外汇登记管理规定，给予警告，处 25000 元人民币的罚款。

#### 22 民生银行 CD470（代码：112215470）

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。

本基金投资 22 广州农村商业银行 CD017、22 徽商银行 CD074、22 恒丰银行 CD225、22 上海银行 CD162、22 宁波银行 CD276、22 光大银行 CD185、22 民生银行 CD470 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金除 22 广州农村商业银行 CD017、22 徽商银行 CD074、22 恒丰银行 CD225、22 上海银行 CD162、22 宁波银行 CD276、22 光大银行 CD185、22 民生银行 CD470 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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

无。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额            |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | —             |
| 2  | 应收清算款 | —             |
| 3  | 应收股利  | —             |
| 4  | 应收利息  | —             |
| 5  | 应收申购款 | 21,507,390.17 |
| 6  | 其他应收款 | —             |
| 7  | 待摊费用  | —             |
| 8  | 其他    | —             |
| 9  | 合计    | 21,507,390.17 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 109,082      | 6,798.55      | 288,459,042.14 | 38.90%     | 453,140,181.83 | 61.10%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 596,032.64 | 0.08%    |

### 9.3 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

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | —                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10              |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                   |
|---------------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 12 月 13 日）基金份额总额 | 643,547,727.44    |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 643,547,727.44    |
| 本报告期基金总申购份额                     | 14,782,474,360.78 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                   | 14,684,422,864.25 |
| 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                    | 741,599,223.97    |

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 基金管理人：2022 年 5 月 23 日起，增聘李祥源先生担任中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。

2. 基金托管人托管部门：本报告期内，经上海浦东发展银行股份有限公司决定，总行资产托管部原总经理孔建同志自 2022 年 11 月 7 日起不再担任资产托管部总经理职务，由李国光同志担任部门负责人。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 28,000.00 元；截至 2022 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供 1 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 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，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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<br>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<br>成交总额的比 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |

|                |   |   | 例 |   |   |   |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 国盛证券有<br>限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |

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。

3：本报告期内本基金新租用 1 个交易单元。

## 11.7.2 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<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额   | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
| 国盛证券有<br>限责任公司 | -    | -                    | -      | -                          | -    | -                    |

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                | 法定披露方式                    | 法定披露日期          |
|----|-----------------------------------------------------|---------------------------|-----------------|
| 1  | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告          | 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 11 日 |
| 2  | 关于中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资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 20 日 |
| 3  | 关于中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资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 24 日 |
| 4  | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停大额申购业务的公告             | 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 27 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 1 月 28 日 |
| 7  | 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 |
| 8  | 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 18 日 |
| 9  | 关于中航基金管理有限公司旗下中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资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 18 日 |
| 10 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2022 年第 1 季度报告         | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2022 年 4 月 21 日 |
| 11 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停大额申购业务的公告             | 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 |
| 12 | 关于中航基金管理有限公司旗下中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资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 5 月 11 日 |
| 13 | 关于中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金增聘基                   | 中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电      | 2022 年 5 月 24 日 |

|    |                                                     |                                           |                 |
|----|-----------------------------------------------------|-------------------------------------------|-----------------|
|    | 金经理的公告                                              | 子披露网站                                     |                 |
| 14 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金产品资料概要（更新）            | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2022 年 5 月 25 日 |
| 15 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资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 5 月 25 日 |
| 16 | 关于中航基金管理有限公司旗下中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资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 5 月 25 日 |
| 17 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停大额申购业务的公告             | 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 31 日 |
| 18 | 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 |
| 19 | 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 |
| 20 | 关于中航基金管理有限公司旗下中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资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 7 月 13 日 |
| 21 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2022 年第 2 季度报告         | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2022 年 7 月 20 日 |
| 22 | 中航基金管理有限公司关于增加江海证券股份有限公司为销售机构的公告                    | 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 8 月 19 日 |
| 23 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2022 年中期报告             | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2022 年 8 月 30 日 |
| 24 | 中航基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“中航基金”名义进行诈骗的风险提示          | 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 9 月 6 日  |
| 25 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停大额申购业务的公告             | 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 9 月 7 日  |
| 26 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天                                 | 中国证券报、管理人网                                | 2022 年 9 月 28 日 |

|    |                                                   |                           |                  |
|----|---------------------------------------------------|---------------------------|------------------|
|    | 持有期证券投资基金暂停大额申购业务的公告                              | 站、中国证监会基金电子披露网站           |                  |
| 27 | 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 10 月 20 日 |
| 28 | 中航基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告                  | 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 10 月 20 日 |
| 29 | 中航基金管理有限公司关于增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构的公告            | 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 10 月 25 日 |
| 30 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2022 年第 3 季度报告       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2022 年 10 月 25 日 |
| 31 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资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 12 月 12 日 |
| 32 | 中航中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金产品资料概要（更新）          | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2022 年 12 月 12 日 |



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 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

### 13.3 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](http://www.avicfund.cn)
3. 拨打本公司客户服务电话垂询: 400-666-2186

中航基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日