

中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证
券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于 2024 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	18

6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	47
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中航恒宇港股通价值优选混合发起	
基金主代码	019309	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 27 日	
基金管理人	中航基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	30,745,080.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中航恒宇港股通价值优选混合发起 A	中航恒宇港股通价值优选混合发起 C
下属分级基金的交易代码:	019309	019310
报告期末下属分级基金的份额总额	26,322,609.33 份	4,422,470.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选具有成长确定性的优质上市公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	(一) 大类资产配置策略 (二) 股票投资策略 (三) 债券投资策略 (四) 股指期货交易策略 (五) 国债期货交易策略 (六) 资产支持证券投资策略 (七) 存托凭证投资策略 (八) 可转换债券、可交换债券投资策略 (九) 参与融资业务策略
业绩比较基准	恒生指数收益率 (使用估值汇率折算) *80% + 上证国债指数收益率 *20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 本基金将投资于港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中航基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘建
	联系电话	010-56716166
	电子邮箱	liujian@avicfund.cn
客户服务电话	400-666-2186	95595
传真	010-56716198	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

	层 B1001 号	
办公地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元	北京市西城区太平桥大街 25 号 中国光大中心
邮政编码	100101	100033
法定代表人	杨彦伟	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中航基金管理有限公司	北京市朝阳区天辰东路 1 号院北京 亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中航恒宇港股通价值优选混合发起 A	中航恒宇港股通价值优选混合发起 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日 - 2024年6月30日)	报告期(2024年1月1日 - 2024年6月30日)
本期已实现收益	-281,983.51	-48,362.05
本期利润	-1,326,449.54	-264,302.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0503	-0.0638
本期加权平均净值利润率	-5.62%	-7.14%
本期基金份额净值增长率	-5.26%	-5.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-2,922,481.04	-507,995.92
期末可供分配基金份额利润	-0.1110	-0.1149
期末基金资产净值	23,400,128.29	3,914,474.95
期末基金份额净值	0.8890	0.8851
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-11.10%	-11.49%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中航恒宇港股通价值优选混合发起 A

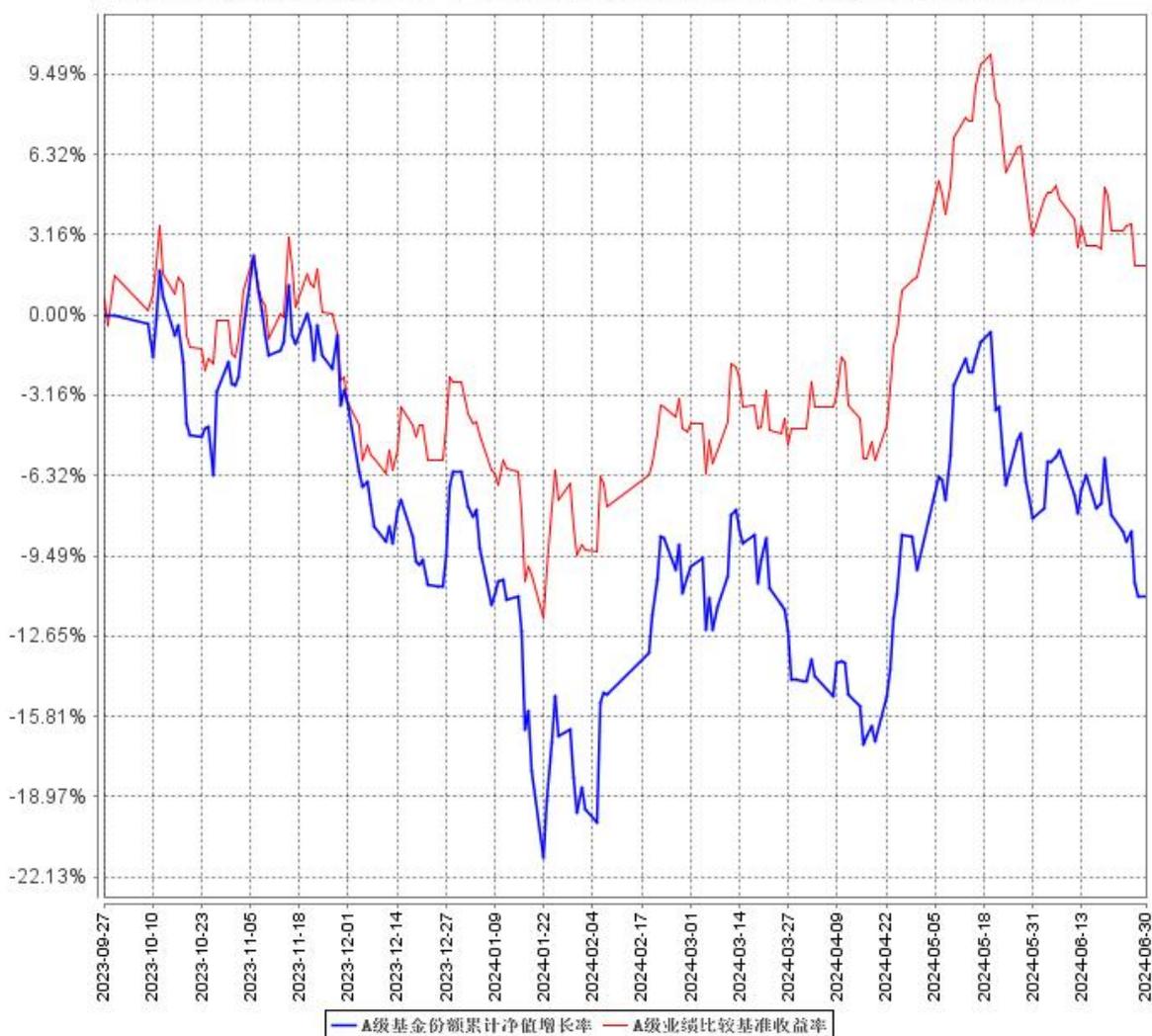
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.37%	1.11%	-1.15%	0.89%	-2.22%	0.22%
过去三个月	3.84%	1.37%	6.73%	1.10%	-2.89%	0.27%
过去六个月	-5.26%	1.61%	4.74%	1.16%	-10.00%	0.45%
自基金合同生效起至今	-11.10%	1.51%	1.96%	1.14%	-13.06%	0.37%

中航恒宇港股通价值优选混合发起 C

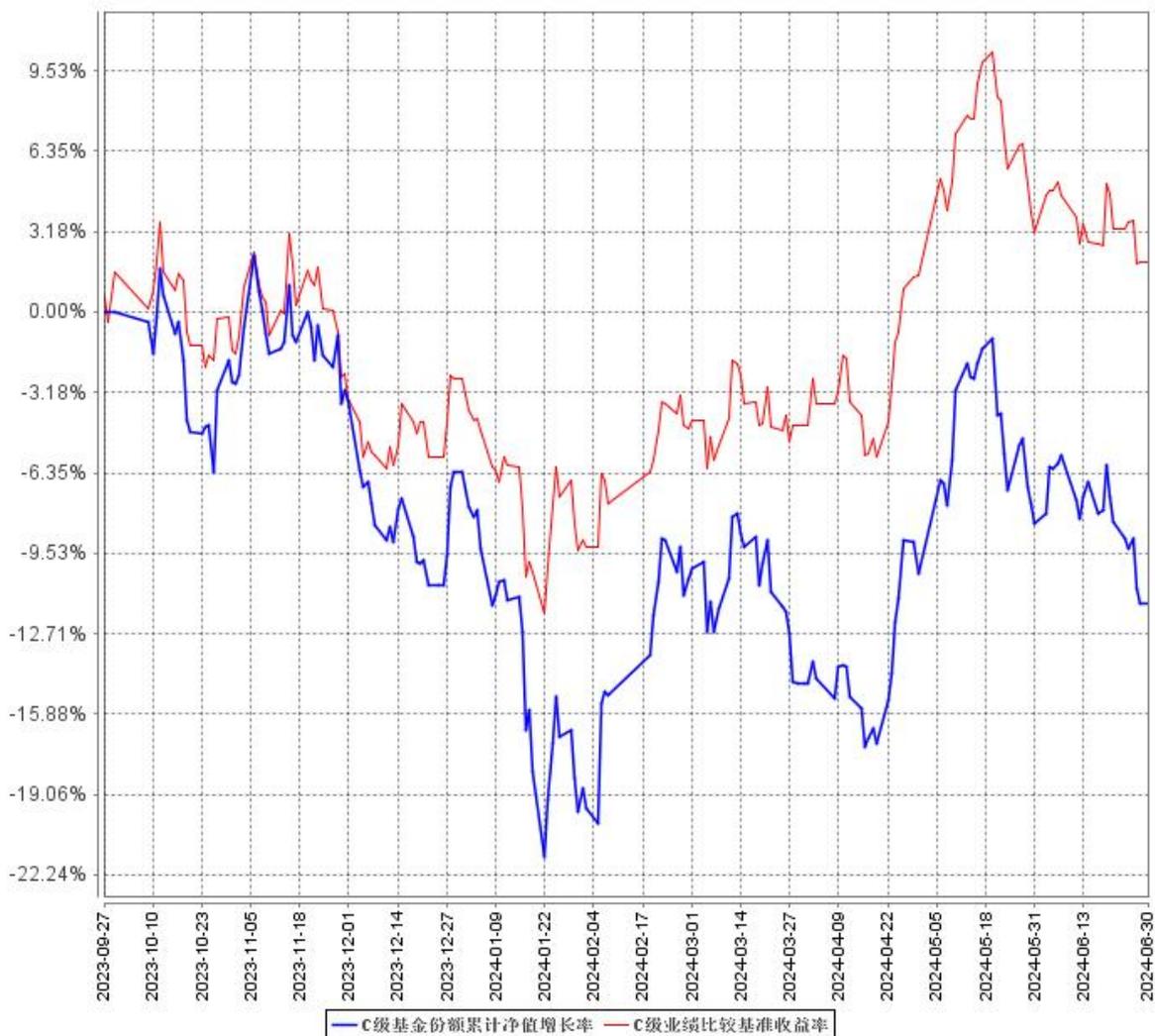
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.43%	1.11%	-1.15%	0.89%	-2.28%	0.22%
过去三个月	3.70%	1.37%	6.73%	1.10%	-3.03%	0.27%
过去六个月	-5.53%	1.61%	4.74%	1.16%	-10.27%	0.45%
自基金合同生效起至今	-11.49%	1.51%	1.96%	1.14%	-13.45%	0.37%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金合同于 2023 年 9 月 27 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
 2. 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中航基金管理有限公司成立于 2016 年 6 月 16 日，是经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1249 号文许可批准设立、为客户提供专业基金管理服务的全国性基金管理公司。公司总部设在北京，注册资本为 30,000 万元人民币，经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王森	基金经理	2023 年 9 月 27 日	-	7	硕士研究生。曾供职于渤海人寿保险股份有限公司资产管理中心担任股票投资经理、光大兴陇信托有限责任公司资本市场与投资总部担任投资经理。2021 年 7 月加入中航基金管理有限公司，现担任权益投资部基金经理。
龙川	基金经理	2023 年 9 月 27 日	-	13	统计博士学位，具有 8 年海外投资管理经验，10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于美国 Susquehanna International Group (SIG)担任投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司担任首席研究员、上海东方证券资产管理有限公司担任量化投资总监、安信基金管理有限责任公司担任量化投资部总经理。2020 年 2 月起加入中航基金管理有限公司，现担任中航基金管理有限公司量化投资部负责人，中航基金管理有限公司上海分公司总经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决

定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度。在统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在 2024 年上半年，中国宏观经济展现了稳健前行的态势。国内生产总值（GDP）实现了 5.0% 的同比增长，即便第二季度的增速有所放缓，但整体经济的稳定发展和长期向好的趋势依旧坚固。回望 2024 年上半年，香港股市经历了波动中的上升态势，成功演绎了两波反弹行情。至 6 月 30 日收盘，恒生指数与恒生中国企业指数均呈现出正增长，而恒生科技指数虽略有下调，但整体市场仍显示出韧性。行业间的表现呈现出分化的格局：能源和原材料行业领涨市场，资讯科技、电

讯和公用事业板块也展现出了积极的增长势头；相比之下，医疗保健行业则遭受了较大的跌幅。这一现象反映出市场对不同行业前景的不同预期和信心。

本产品投资策略上坚守“宏观为锚，价值为基，交易为辅”，配置上坚持“自下而上”寻找好公司的选股原则，在报告期内对部分个股进行了适当调整，行业上继续以医药、工业和金融为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航恒宇港股通价值优选混合发起 A 基金份额净值为 0.8890 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.26%；截至本报告期末中航恒宇港股通价值优选混合发起 C 基金份额净值为 0.8851 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.53%；同期业绩比较基准收益率为 4.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从估值的角度审视，当前恒生指数的估值水平处于历史估值的中低位区间，这为其中长期的投资配置提供了较高的价值。在全球主要股指的横向对比中，恒生指数的市盈率（PE）估值相对较低，这无疑增强了其对全球资金的吸引力。

进一步观察恒生指数的股权风险溢价（ERP），我们发现其值已接近过去三年滚动平均值减去一个标准差的水平，这表明市场情绪已经得到了显著的修复。从市场情绪的角度来看，港股市场的风险偏好预期将有所提升。

展望下半年，随着国内经济的持续复苏和政策环境的积极向好，投资者的信心预期将得到进一步的加强，市场情绪也有望迎来新一轮的提升。这为港股市场的稳健发展和投资机会的涌现奠定了坚实的基础。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由投资研究、交易、基金事务、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，投资研究部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	920,987.22	1,442,810.39
结算备付金		2,048,931.20	1,143,313.49
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	24,156,190.00	26,680,297.00
其中：股票投资		24,156,190.00	26,680,297.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		259,093.20	-
应收申购款		370.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		27,385,571.62	29,266,420.88
负债和净资产			
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3.83	4.17

应付赎回款		8.91	131,628.36
应付管理人报酬		27,988.63	29,142.21
应付托管费		4,664.77	4,857.02
应付销售服务费		2,002.34	1,996.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	36,299.90	133,284.79
负债合计		70,968.38	300,913.35
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	30,745,080.20	30,874,839.26
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-3,430,476.96	-1,909,331.73
净资产合计		27,314,603.24	28,965,507.53
负债和净资产总计		27,385,571.62	29,266,420.88

注：①报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 30,745,080.20 份，中航恒宇港股通价值优选混合发起 A 基金份额净值 0.8890 元，基金份额总额 26,322,609.33 份；中航恒宇港股通价值优选混合发起 C 基金份额净值 0.8851 元，基金份额总额 4,422,470.87 份。

②本基金基金合同于 2023 年 9 月 27 日生效，无可比期间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,352,634.24
1.利息收入		4,791.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,791.00
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-99,660.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-488,237.39
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	388,577.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,260,406.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	2,641.20
减：二、营业总支出		238,117.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	162,673.03
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,112.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,012.15
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	37,320.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,590,751.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,590,751.89
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-1,590,751.89

6.3 净资产变动表

会计主体：中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	30,874,839.26	-	-1,909,331.73	28,965,507.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	30,874,839.26	-	-1,909,331.73	28,965,507.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-129,759.06	-	-1,521,145.23	-1,650,904.29
（一）、综合收益总额	-	-	-1,590,751.89	-1,590,751.89
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-129,759.06	-	69,606.66	-60,152.40
其中：1.基金申购款	1,587,222.75	-	-116,548.49	1,470,674.26
2.基金赎回款	-1,716,981.81	-	186,155.15	-1,530,826.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	30,745,080.20	-	-3,430,476.96	27,314,603.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘建	_____ 裴荣荣	_____ 韩丹
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2023]1868 号文《关于准予中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金注册的批复》，由中航基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资

基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）等规定公开募集。经向中国证监会备案，于 2023 年 9 月 27 日募集成立。本基金的基金管理人为中航基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，基金合同生效日的基金份额总额为 31,020,491.74 份，有效认购户数为 747 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息折合基金份额 3,488.42 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号—半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—一年度和中期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本报告期本基金无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税明电【2008】2号《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税征收方式的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年09月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、财税【2015】101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	920,987.22
等于：本金	920,804.32
加：应计利息	182.90
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	920,987.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	27,233,064.78	-	24,156,190.00	-3,076,874.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债	交易所市场	-	-	-	-
券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		27,233,064.78	-	24,156,190.00	-3,076,874.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期本基金未计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末本基金未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	36,299.90
合计	36,299.90

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航恒宇港股通价值优选混合发起 A		
项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	26,639,223.37	26,639,223.37
本期申购	170,120.77	170,120.77
本期赎回(以“-”号填列)	-486,734.81	-486,734.81
– 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	26,322,609.33	26,322,609.33

金额单位：人民币元

中航恒宇港股通价值优选混合发起 C		
项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,235,615.89	4,235,615.89
本期申购	1,417,101.98	1,417,101.98
本期赎回(以“-”号填列)	-1,230,247.00	-1,230,247.00
– 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	4,422,470.87	4,422,470.87

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中航恒宇港股通价值优选混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-85,842.88	-1,556,199.31	-1,642,042.19
加：会计政策变更（若有）	–	–	–
前期差错更正（若有）	–	–	–
其他（若有）	–	–	–
本期期初	-85,842.88	-1,556,199.31	-1,642,042.19
本期利润	-281,983.51	-1,044,466.03	-1,326,449.54
本期基金份额交易产生的变动数	910.55	45,100.14	46,010.69
其中：基金申购款	-1,840.14	-10,089.51	-11,929.65

基金赎回款	2,750.69	55,189.65	57,940.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-366,915.84	-2,555,565.20	-2,922,481.04

单位：人民币元

中航恒宇港股通价值优选混合发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,025.29	-247,264.25	-267,289.54
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-20,025.29	-247,264.25	-267,289.54
本期利润	-48,362.05	-215,940.30	-264,302.35
本期基金份额交易产生的变动数	-11,538.82	35,134.79	23,595.97
其中：基金申购款	-26,627.19	-77,991.65	-104,618.84
基金赎回款	15,088.37	113,126.44	128,214.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-79,926.16	-428,069.76	-507,995.92

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	3,099.90
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	1,691.10
其他	-
合计	4,791.00

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,751,030.74

减：卖出股票成本总额	2,233,931.57
减：交易费用	5,336.56
买卖股票差价收入	-488,237.39

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本报告期本基金无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本报告期本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	388,577.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	388,577.28

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,260,406.33
——股票投资	-1,260,406.33
——债券投资	-
——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	-1,260,406.33

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,641.20
合计	2,641.20

6.4.7.22 信用减值损失

本报告期本基金无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	11,436.88
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
深港通证券组合费	1,020.41
合计	37,320.31

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中航基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

中航证券有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
----------	----------------

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中航证券有限公司	2,721,261.64	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中航证券有限公司	2,177.01	100.00%	-	-

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取、并由券商承担的费用后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	162,673.03
其中：支付销售机构的客户维护费	27,976.89
应支付基金管理人的净管理费	134,696.14

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	27,112.16

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航恒宇港股通价值 优选混合发起 A	中航恒宇港股通价值优 选混合发起 C	合计
中国光大银行股份有限公司	-	3,045.50	3,045.50
中航基金管理有限公司	-	26.60	26.60
合计	-	3,072.10	3,072.10

注：①计提标准：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。本基金 C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本报告期本基金均无转融通证券出借业务。

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

本报告期本基金无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中航恒宇港股通价值优选混合发起 A				
关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中航证券有限公司	10,000,888.97	32.5300%	10,000,888.97	32.3900%

注：上述关联方投资本基金时，按照本基金基金合同、招募说明书约定的费率标准收取相应的手续费，并履行了信息披露义务。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	920,987.22	3,099.90
中航证券有限公司	1,584,300.48	968.63

注：包括活期存款，存在托管银行的定期存款，券商结算模式下的结算备付金存款。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。本基金投资于港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目的是在力求在严格控制风险的前提下,谋求实现基金资产的长期稳定增长的投资目标。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险发生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的货币资金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，与该货币资金相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险事件发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券及同业存单。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期报告末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于本报告期末，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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	920,987.22	-	-	-	920,987.22
结算备付金	2,048,931.20	-	-	-	2,048,931.20
交易性金融资产	-	-	-	24,156,190.00	24,156,190.00
应收股利	-	-	-	259,093.20	259,093.20
应收申购款	-	-	-	370.00	370.00
资产总计	2,969,918.42	-	-	24,415,653.20	27,385,571.62
负债					
应付清算款	-	-	-	3.83	3.83
应付赎回款	-	-	-	8.91	8.91
应付管理人报酬	-	-	-	27,988.63	27,988.63
应付托管费	-	-	-	4,664.77	4,664.77
应付销售服务费	-	-	-	2,002.34	2,002.34
其他负债	-	-	-	36,299.90	36,299.90
负债总计	-	-	-	70,968.38	70,968.38
利率敏感度缺口	2,969,918.42	-	-	24,344,684.82	27,314,603.24

上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,442,810.39	-	-	-	1,442,810.39
结算备付金	1,143,313.49	-	-	-	1,143,313.49
交易性金融资产	-	-	-	-26,680,297.00	26,680,297.00
资产总计	2,586,123.88	-	-	-26,680,297.00	29,266,420.88
负债					
应付清算款	-	-	-	4.17	4.17
应付赎回款	-	-	-	131,628.36	131,628.36
应付管理人报酬	-	-	-	29,142.21	29,142.21
应付托管费	-	-	-	4,857.02	4,857.02
应付销售服务费	-	-	-	1,996.80	1,996.80
其他负债	-	-	-	133,284.79	133,284.79
负债总计	-	-	-	300,913.35	300,913.35
利率敏感度缺口	2,586,123.88	-	-	-26,379,383.65	28,965,507.53

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资或资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.00% (2023 年 12 月 31 日: 0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 年 12 月 31 日: 同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

交易性金融资产	-	24,156,190.0	-	24,156,190.0
应收股利	-	259,093.20	-	259,093.20
资产合计	-	24,415,283.20	-	24,415,283.20
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	24,415,283.20	-	24,415,283.20
项目	上年度末			
	2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	26,680,297.0	-	26,680,297.0
应收股利	-	-	-	-
资产合计	-	26,680,297.0	-	26,680,297.0
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	26,680,297.0	-	26,680,297.0

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币 升值 5%	1,207,809.50	1,334,014.85
	所有外币相对人民币 贬值 5%	-1,207,809.50	-1,334,014.85

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	24,156,190.00	88.44	26,680,297.00	92.11
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	24,156,190.00	88.44	26,680,297.00	92.11

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,511,701.57	1,283,855.83
	业绩比较基准下降 5%	-1,511,701.57	-1,283,855.83

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	24,156,190.00	26,680,297.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	24,156,190.00	26,680,297.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,156,190.00	88.21
	其中：股票	24,156,190.00	88.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,969,918.42	10.84
8	其他各项资产	259,463.20	0.95
9	合计	27,385,571.62	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 24,156,190.00 元，占净值比例 88.44%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例 (%)
消费者非必需品	1,493,900.00	5.47
金融	5,678,936.00	20.79
医疗保险	12,165,030.00	44.54
工业	2,929,080.00	10.72
信息技术	1,889,244.00	6.92
合计	24,156,190.00	88.44

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	------	---------------

1	01093	石药集团	398,000	2,260,640.00	8.28
2	01099	国药控股	112,000	2,121,280.00	7.77
3	03888	金山软件	91,800	1,889,244.00	6.92
4	01801	信达生物	52,000	1,746,680.00	6.39
5	00363	上海实业控股	160,000	1,702,400.00	6.23
6	01513	丽珠医药	70,000	1,642,200.00	6.01
7	02601	中国太保	90,200	1,569,480.00	5.75
8	02628	中国人寿	146,000	1,471,680.00	5.39
9	06066	中信建投证券	278,500	1,470,480.00	5.38
10	00038	第一拖拉机股份	182,000	1,226,680.00	4.49
11	03908	中金公司	147,200	1,167,296.00	4.27
12	00013	和黄医药	46,500	1,167,150.00	4.27
13	03320	华润医药	208,000	1,098,240.00	4.02
14	00874	白云山	48,000	904,800.00	3.31
15	02020	安踏体育	11,800	807,710.00	2.96
16	02331	李宁	44,500	686,190.00	2.51
17	09995	荣昌生物	28,000	626,080.00	2.29
18	00867	康哲药业	99,000	597,960.00	2.19

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	03320	华润医药	970,230.90	3.35

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	01513	丽珠医药	1,029,809.50	3.77
2	00867	康哲药业	721,221.24	2.64

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	970,230.90
卖出股票收入（成交）总额	1,751,030.74

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

中国太保（代码：02601）

2024年1月30日，国家外汇管理局上海市分局对中国太保未按规定提交材料（1、未按规定报送资料报表；2、直接申报数据错报、漏报、多报）给予警告，处罚款15万元人民币。

中信建投证券（代码：06066）

2024 年 6 月 20 日，上海证券交易所对中信建投证券作为大参林医药集团股份有限公司向特定对象发行股票的项目保荐人，存在保荐职责履行不到位的情形，采取出具警示函的监管措施。

2024 年 5 月 28 日，上海证券交易所对中信建投证券作为公司债券 23 格地 01 的主承销商和受托管理人，咨询审计机构工作底稿留痕不足，未对发行人管理层制作访谈记录，未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告，采取出具警示函的监管措施。

2024 年 5 月 14 日，上海证券交易所对中信建投证券作为深圳中兴新材技术股份有限公司首次公开发行股票并在科创板上市申请项目的保荐人，在相关项目的保荐工作中，存在保荐职责履行不到位的情形，采取出具警示函的监管措施。

2024 年 4 月 30 日，中国证券监督管理委员会北京监管局对中信建投证券开展场外期权及自营业务不审慎，对从业人员管理不到位的情况，公司治理不规范，反映出公司未能有效实施合规管理、风险管理和内部控制，责令公司就上述问题认真整改。

2024 年 4 月 30 日，中国证券监督管理委员会广东监管局对中信建投证券作为格力地产股份有限公司债券“23 格地 01”的主承销商和受托管理人，咨询审计机构工作底稿留痕不足，未对发行人管理层制作访谈记录，未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告，采取出具警示函的行政监管措施。

2024 年 1 月 24 日，中国证券监督管理委员会山东监管局对中信建投证券作为云鼎科技的保荐机构，未能勤勉尽责、持续督导上市公司完善制度、采取措施规范募集资金补充流动资金和偿还债务使用过程，采取出具警示函的监管措施，同时将相关情况记入证券期货市场诚信档案数据库。

2024 年 1 月 3 日，深圳证券交易所对中信建投证券 2022 年业绩预告(快报)公告违规、对发行人业绩预计情况未审慎发表专业意见，采取书面警示的自律监管措施。

本基金投资中信建投证券、中国太保的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金除中信建投证券、中国太保外，投资的前十大证券的发行主体本期没有出现监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责和处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	259,093.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	370.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	259,463.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中航恒宇港股通价值优选混合发起 A	449	58,624.97	20,001,777.94	75.99%	6,320,831.39	24.01%
中航恒宇港股通价值优选混合发起 C	169	26,168.47	-	-	4,422,470.87	100.00%
合计	597	51,499.30	20,001,777.94	65.06%	10,743,302.26	34.94%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中航恒宇港股通价值优选混合发起 A	60,114.20	0.23%
	中航恒宇港股通价值优选混合发起 C	-	-
	合计	60,114.20	0.20%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	中航恒宇港股通价值优选混合发起 A	0~10
	中航恒宇港股通价值优选混合发起 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中航恒宇港股通价值优选混合发起 A	-
	中航恒宇港股通价值优选混合发起 C	-
	合计	-

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	10,000,888.97	32.53	10,000,888.97	32.53	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,888.97	32.53	10,000,888.97	32.53	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航恒宇港股通 价值优选混合发 起 A	中航恒宇港股通 价值优选混合发 起 C
基金合同生效日（2023 年 9 月 27 日）基金份 额总额	26,764,672.64	4,255,819.10
本报告期期初基金份额总额	26,639,223.37	4,235,615.89
本报告期基金总申购份额	170,120.77	1,417,101.98
减：本报告期基金总赎回份额	486,734.81	1,230,247.00
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	26,322,609.33	4,422,470.87

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2024 年 1 月 31 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 1 月 29 日起，王华先生不再担任中航基金管理有限公司副总经理。

2. 2024 年 7 月 1 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 6 月 29 日起，刘建先生不再担任公司总经理职务、另有工作安排；武国强先生不再担任公司督察长职务。

3. 2024 年 7 月 1 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 7 月 1 日起，刘建先生担任公司督察长职务并且代履行公司总经理职务，代履行期限不超过 6 个月。

4. 本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

中航证券有限公司	2	2,721,261.64	100.00%	2,177.01	100.00%	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式。

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

3、交易单元的选择标准和程序

选择标准：①实力雄厚，信誉良好；②研究、交易实力较强，选择需要支付研究服务费用的证券公司，应考察其研究服务能力，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；③财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；④经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 19 日
2	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 31 日
3	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 5 日
4	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 27 日
5	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 1 日
6	中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
7	中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金 2024 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	2024 年 4 月 20 日
8	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 8 日
9	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 21 日
10	关于中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 5 日
11	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 19 日
12	中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101-20240630	10,000,888.97	-	-	10,000,888.97	32.53%
	2	20240101-20240630	10,000,888.97	-	-	10,000,888.97	32.53%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金本报告期内存在单一持有人持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。当单一持有人持有份额超 20%时，将面临客户集中度较高的风险，对基金规模的稳定性带来隐患，可能的赎回将可能引发产品的流动性风险。本管理人将加强与客户的沟通，尽量了解申赎意向，审慎确认大额申购与大额赎回，提前做好投资计划，有效防控产品流动性风险，公平对待投资者，保障中小投资者合法权益，本基金管理人拥有完全、独立的投资决策权，不受特定投资者的影响。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金募集的文件
2. 《中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照
5. 报告期内中航恒宇港股通价值优选混合型发起式证券投资基金在规定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

中航基金管理有限公司，地址：北京市朝阳区天辰东路 1 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801\805\806 单元。

12.3 查阅方式

1. 营业时间内到本公司免费查阅
2. 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.avicfund.cn
3. 拨打本公司客户服务电话垂询：400-666-2186

中航基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日