

中航航行宝货币市场基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：国泰海通证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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	5
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	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 债券回购融资情况	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限	38
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	39
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	40

7.9 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	44
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	44
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	45
10.9 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中航航行宝货币市场基金	
基金简称	中航航行宝	
基金主代码	004133	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日	
基金管理人	中航基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	6,018,692,840.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中航航行宝 A	中航航行宝 B
下属分级基金的交 易代码	004133	015972
报告期末下属分级 基金的份额总额	29,337,118.11 份	5,989,355,722.16 份

注：本基金 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险和保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取资产配置策略、个券选择策略、利用短期市场机会的灵活策略、资产支持证券投资策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。 1、资产配置策略 基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等，以及各投资品种的市场规模、交易活跃程度、相对收益、信用等级、平均到期期限等重要指标的综合判断，并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征，决定基金资产在债券、银行存款、资产支持证券等各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。 2、个券选择策略 在考虑安全性因素的前提下，本基金管理人将积极发掘价格被低估的且符合流动性要求的适合投资的品种。通过分析各个具体金融产品的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级状况、流动性指标等因素进行证券选择，选择风险收益配比最合理的证券作为投资对象。 3、利用短期市场机会的灵活策略 由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡；新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因，研究其中的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会获得超额收益。

	4、资产支持证券投资策略 本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。 5、回购策略 根据回购市场利率走势变化情况，在回购利率较低时，本基金在严格遵守相关法律法规的前提下，利用正回购操作循环融入资金进行债券投资，提高基金收益水平。 另一方面，本基金将把握资金供求的瞬时效应，积极捕捉收益率峰值的短线机会。在回购利率突增的情况下，本基金可通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。 6、现金流管理策略 出于较高的流动性要求，本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中航基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	宋鑫	帅芳
	联系电话	010-56716167	021-38677947
	电子邮箱	songxin@avicfund.cn	tgrxp@tg.gtth.com
客户服务电话		400-666-2186	021-38917599-5
传真		010-56716198	021-50872603
注册地址		北京市石景山区五一剧场南路2号院1号楼7层702E	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		北京市朝阳区天辰东路1号院亚洲金融大厦D座第8层801/805/806单元	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		100101	200041
法定代表人		杨彦伟	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金中期报告置备地点	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 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

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	中航航行宝 A	中航航行宝 B
本期已实现收益	200,023.85	39,226,085.30
本期利润	200,023.85	39,226,085.30
本期净值收益率	0.6054%	0.6755%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	中航航行宝 A	中航航行宝 B
期末基金资产净值	29,337,118.11	5,989,355,722.16
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末 指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	中航航行宝 A	中航航行宝 B
累计净值收益率	22.6404%	7.8151%

注：①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金每日分配收益，按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中航航行宝 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
----	--------------	---------------------	----------------	-----------------------	-----	-----

过去三个月	0.2879%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	-0.048 7%	0.0008 %
过去六个月	0.6054%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	-0.064 1%	0.0006 %
过去一年	1.2739%	0.0005%	1.3500%	0.0000%	-0.076 1%	0.0005 %
过去三年	5.0883%	0.0012%	4.0537%	0.0000%	1.0346 %	0.0012 %
过去五年	9.1155%	0.0013%	6.7537%	0.0000%	2.3618 %	0.0013 %
过去七年	13.4346 %	0.0014%	9.4574%	0.0000%	3.9772 %	0.0014 %
自基金合同生效起 至今	22.6404 %	0.0029%	12.7381%	0.0000%	9.9023 %	0.0029 %

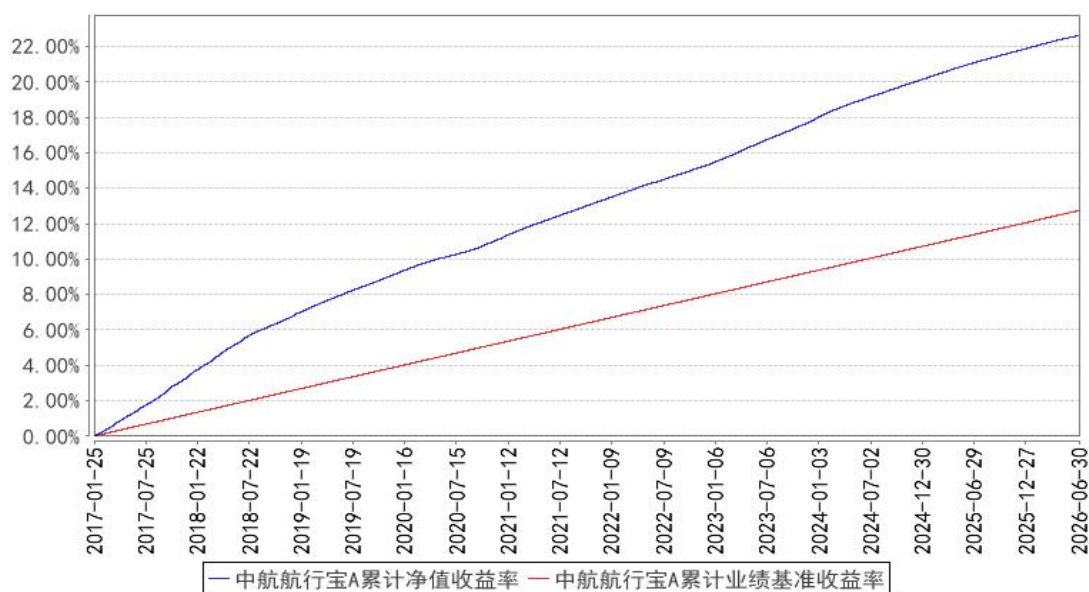
中航航行宝 B

阶段	份额净 值收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	0.3229%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	-0.013 7%	0.0008 %
过去六个月	0.6755%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	0.0060 %	0.0006 %
过去一年	1.4162%	0.0005%	1.3500%	0.0000%	0.0662 %	0.0005 %
过去三年	5.5312%	0.0012%	4.0537%	0.0000%	1.4775 %	0.0012 %
自基金合同生效起 至今	7.8151%	0.0013%	5.4296%	0.0000%	2.3855 %	0.0013 %

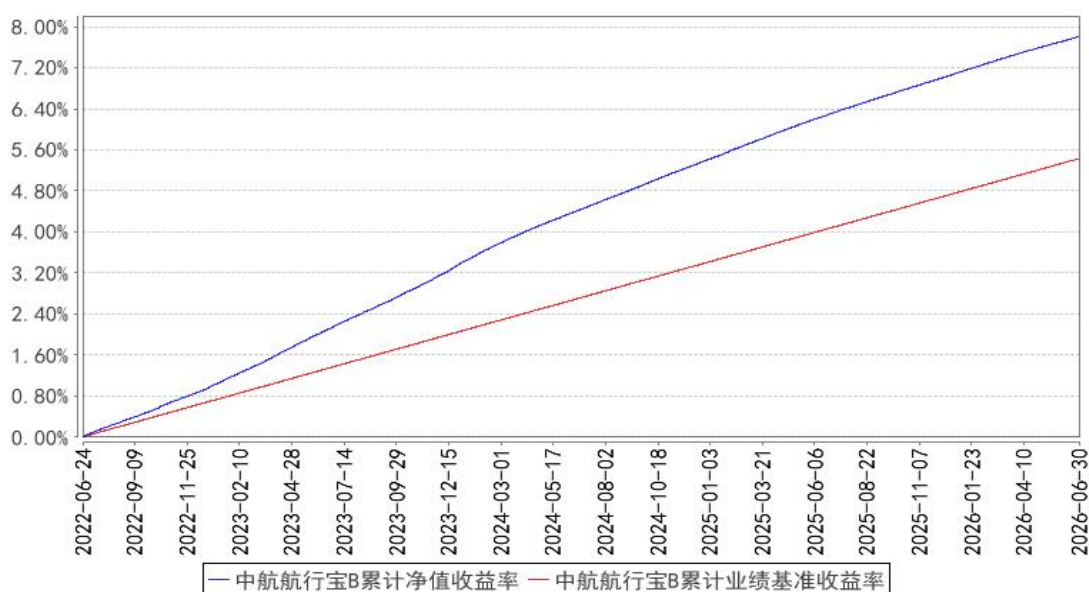
注： 本基金 B 类份额自 2022 年 6 月 24 日存续。

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

中航航行宝A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中航航行宝B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金B类份额自2022年6月24日存续。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中航基金管理有限公司成立于2016年6月16日，是经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1249号文许可批准设立、为客户提供专业基金管理服务的全国性基金管理公司。公司总部设在北京，注册资本金为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		
李祥源	本基金的基金经理	2022 年 5 月 23 日	-	10 年	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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《中航航空宝货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，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

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 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

上半年以来，债券收益率曲线稳步下行，受益于宽松的资金面，中短端资产表现良好，进入二季度后，长端表现优于中短端，期限利差有所收敛。上半年债市的主线围绕通胀回归、央行态度和外围战争进行，央行虽给与市场宽松维稳信号，但收长放短意图明显，市场双降预期进一步降温，增加了隔夜OMO，完善了利率走廊，进一步明确利率合意区间。外围战争给国内带来的不确定性仍在，进入二季度后战局缓和油价带来的输入型通胀担忧逐步下降，银行机构融出量价相对稳定，资金面前松后紧，此前超跌的长债有所补涨。债市矛盾点从通胀数据的回归转回监管对金融机构的管控以及央行对债市收益率下行的担忧，金融数据偏中性，结构不佳，微观层面的能动性仍不足。二季度CPI和PPI表现符合预期，通胀压力不大，制造业PMI持续改善，现阶段基本面对债市较为友好，中短端收益率重回此前低点。上半年信用债市场整体表现较好，信用利差有所收敛。上半年美联储没有重启加息，但市场已有预期，伊朗战争给通胀带来较大的压力，中期选举带来的不确定性进一步增加，美元货币地位逐步下降，我国汇率维持强势。上半年货币类资产表现良好，存单性价比较高，均衡配置类货币基金表现良好。

本组合在报告期内仍主要投资于同业存单、高等级信用债等流动性较好的资产，剩余期限维持在适中水平，杠杆水平适中。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内中航航空宝A的基金份额净值收益率为0.6054%，本报告期内中航航空宝B的基金份额净值收益率为0.6755%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宽松的货币政策仍没有变化，财政发力仍需宽货币的协同，市场对降准降息重燃预期，在国内经济仍需提振和海外市场不确定性较大的基本面下，债券收益率易下难上，货币类资产性价比仍在。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由投资研究、交易、基金事务、风险管理、合规等部门

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金 A 级应分配且已分配利润 200,023.85 元，B 级应分配且已分配利润 39,226,085.30 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在中航航行宝货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、利润分配等情况进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中航航行宝货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,827,490,370.21	1,117,392,341.11
结算备付金		5,556,095.66	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,601,914,619.21	2,441,387,533.14
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,601,914,619.21	2,441,387,533.14
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	1,685,207,465.53	1,743,386,336.29
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		92,893.26	50,646,649.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,120,261,443.87	5,352,812,860.18
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		100,003,561.64	589,022,940.10
应付清算款		-	-
应付赎回款		97,975.96	13,608.58
应付管理人报酬		743,163.31	538,753.85
应付托管费		247,721.04	179,584.58
应付销售服务费		53,048.34	41,160.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		28,236.96	13,340.73
应付利润		224,482.44	206,298.85

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	170,413.91	152,516.58
负债合计		101,568,603.60	590,168,204.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	6,018,692,840.27	4,762,644,655.95
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		6,018,692,840.27	4,762,644,655.95
负债和净资产总计		6,120,261,443.87	5,352,812,860.18

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0000 元，B 类基金份额净值 1.0000 元；基金份额总额 6,018,692,840.27 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 29,337,118.11 份，B 类基金份额总额 5,989,355,722.16 份。

6.2 利润表

会计主体：中航航行宝货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		49,287,918.75	36,652,258.31
1. 利息收入		29,212,244.43	15,234,122.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,731,942.09	4,508,494.58
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		9,480,302.34	10,725,627.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		20,075,674.32	21,418,136.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	20,075,674.32	21,418,136.23
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-

其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	-	-
减：二、营业总支出		9,861,809.60	5,012,457.48
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	4,414,883.29	2,782,258.42
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1,471,627.71	927,419.44
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	317,289.25	215,795.55
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,539,895.08	992,142.95
其中：卖出回购金融资产支出		3,539,895.08	992,142.95
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-3,429.08	6,964.59
7. 税金及附加		14,075.08	5,589.46
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	107,468.27	82,287.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,426,109.15	31,639,800.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,426,109.15	31,639,800.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		39,426,109.15	31,639,800.83

6.3 净资产变动表

会计主体：中航航行宝货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	4,762,644,655.95	-	-	4,762,644,655.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	4,762,644,655.95	-	-	4,762,644,655.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,256,048,184.32	-	-	1,256,048,184.32
(一)、综合收益总额	-	-	39,426,109.15	39,426,109.15
(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)	1,256,048,184.32	-	-	1,256,048,184.32
其中：1. 基金申购款	9,707,986,218.16	-	-	9,707,986,218.16
2. 基金赎回款	-8,451,938,033.84	-	-	-8,451,938,033.84
(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)	-	-	-39,426,109.15	-39,426,109.15
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,018,692,840.27	-	-	6,018,692,840.27
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	4,258,899,153.09	-	-	4,258,899,153.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,258,899,153.	-	-	4,258,899,153.0

	09			9
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,502,424,175.85	-	-	1,502,424,175.85
(一)、综合收益总额	-	-	31,639,800.83	31,639,800.83
(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)	1,502,424,175.85	-	-	1,502,424,175.85
其中：1. 基金申购款	7,153,850,838.90	-	-	7,153,850,838.90
2. 基金赎回款	-5,651,426,663.05	-	-	-5,651,426,663.05
(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)	-	-	-31,639,800.83	-31,639,800.83
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,761,323,328.94	-	-	5,761,323,328.94

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：

裴荣荣

裴荣荣

韩丹

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中航航空宝货币市场基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2016]3041 号文《关于准予中航航空宝货币市场基金注册的批复》，由中航基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》

和《中航航行宝货币市场基金基金合同》（“基金合同”）等规定公开募集。经向中国证监会备案，于 2017 年 1 月 25 日募集成立。本基金的基金管理人为中航基金管理有限公司，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，基金合同生效日的基金份额总额为 520,655,938.43 份，有效认购户数为 324 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息折合基金份额 29,850.43 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中航航行宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布和修订的《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发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《公开募集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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、《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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

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

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税【2017】56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税【2017】90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1. 2027 年 12 月 31 日前，契约制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，可以选择简易计税方法，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. 2027 年 12 月 31 日前，基金买卖债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税；
- 4. 2027 年 12 月 31 日前，存款利息收入不征收增值税；对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。
- 5. 对基金取得的企业债券利息收入，由各兑付机构在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,526,337,390.19
等于：本金	1,526,115,055.78
加：应计利息	222,334.41
定期存款	301,152,980.02
等于：本金	300,000,000.00

加：应计利息	1,157,999.58
减：坏账准备	5,019.56
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	301,152,980.02
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
合计	1,827,490,370.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	2,601,914,619.21	2,602,553,515.06	638,895.85	0.0106
	合计	2,601,914,619.21	2,602,553,515.06	638,895.85	0.0106
资产支持证券		—	—	—	—
合计		2,601,914,619.21	2,602,553,515.06	638,895.85	0.0106

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	—	—
银行间市场	1,685,207,465.53	—
合计	1,685,207,465.53	—

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	88.67
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	72,756.97
其中：交易所市场	-
银行间市场	72,756.97
应付利息	-
预提费用	97,568.27
合计	170,413.91

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航航空宝 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,772,402.28	49,772,402.28
本期申购	167,509,065.27	167,509,065.27
本期赎回（以“-”号填列）	-187,944,349.44	-187,944,349.44
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,337,118.11	29,337,118.11

中航航空宝 B

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,712,872,253.67	4,712,872,253.67
本期申购	9,540,477,152.89	9,540,477,152.89
本期赎回（以“-”号填列）	-8,263,993,684.40	-8,263,993,684.40
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,989,355,722.16	5,989,355,722.16

注：本期申购含基金红利再投、转换入、级别调整入份额；本期赎回含基金转换出、级别调整出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中航航空宝 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	200,023.85	-	200,023.85
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-200,023.85	-	-200,023.85
本期末	-	-	-

中航航空宝 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	39,226,085.30	-	39,226,085.30
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-39,226,085.30	-	-39,226,085.30
本期末	-	-	-

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,499,537.57
定期存款利息收入	2,174,763.70
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,015.93
其他	53,624.89
合计	19,731,942.09

6.4.7.14 股票投资收益

本报告期本基金无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	19,547,299.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	528,374.99
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	20,075,674.32

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,722,468,822.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,718,426,047.87
减：应计利息总额	3,514,399.99
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	528,374.99

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

本报告期本基金无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

本报告期本基金无公允价值收益。

6.4.7.21 其他收入

本报告期本基金无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
银行存款	-3,429.08
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其他债权投资	-
其他	-
合计	-3,429.08

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	28,760.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行划款费	200.00
其他费用	400.00
合计	107,468.27

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、关联关系

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
国泰海通证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中航证券有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	--

当期发生的基金应支付的管理费	4,414,883.29	2,782,258.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	992,902.31	617,334.10
应支付基金管理人的净管理费	3,421,980.98	2,164,924.32

注：①本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，于次月首日起 3 个工作日内按照双方约定的方式从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,471,627.71	927,419.44

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，于次月首日起 3 个工作日内按照双方约定的方式从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航航行宝 A	中航航行宝 B	合计
国泰海通证券股份有限公司	162.45	-	162.45
中航基金管理有限公司	740.63	74,824.95	75,565.58
中航证券有限公司	17,759.35	418.07	18,177.42

合计	18,662.43	75,243.02	93,905.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航航行宝 A	中航航行宝 B	合计
国泰海通证券股份有限公司	163.55	-	163.55
中航基金管理有限公司	235.45	50,030.63	50,266.08
中航证券有限公司	21,592.60	723.13	22,315.73
合计	21,991.60	50,753.76	72,745.36

注：①计提标准：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.15%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的确认日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的确认日起适用 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

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

H 为该类别份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日某类基金份额的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，于次月首日起 3 个工作日内按照双方约定的方式从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	中航航行宝 A	中航航行宝 B
报告期初持有的基金份额	-	68,350,921.59
报告期间申购/	-	462,101.54

买入总份额		
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	68,813,023.13
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.14%
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	中航航行宝 A	中航航行宝 B
报告期初持有的基金份额	-	126,351,595.91
报告期间申购/买入总份额	-	1,079,978.78
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	127,431,574.69
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.21%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中航航行宝 B

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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（%）
国泰海通证券股份有限公司	500,000,000.00	8.31	400,017,612.87	8.40

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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券股份有限公司	830,153,171.32	6,286,975.10	42,576.89	493,466.17

注：托管人国泰海通证券股份有限公司所保管的托管账户开立在中国交通银行股份有限公司

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

中航航空宝 A				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
201,024.09	-	-1,000.24	200,023.85	-
中航航空宝 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
39,206,901.47	-	19,183.83	39,226,085.30	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 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 100,003,561.64 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
112603069	26 农业银	2026 年 7 月 1	99.56	500,000	49,778,511.94

	行 CD069	日			
112603114	26 农业银 行 CD114	2026 年 7 月 1 日	99.80	1,000,000	99,795,412.63
合计				1,500,000	149,573,924.57

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括债券、同业存单等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目的是在保持基金资产安全性、流动性的基础上，力求超过业绩比较基准的稳定收益。

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

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

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

监察稽核部和风险管理部是公司内部控制的职能部门。各职能部门负责从经营管理的各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。

基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。基金的货币资金存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，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，不投资短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。

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。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	321,090,478.12	151,032,296.53
合计	321,090,478.12	151,032,296.53

注：本表主要列示短期融资券、超短期融资券以及剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债和央行票据，信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,280,824,141.09	2,290,355,236.61
合计	2,280,824,141.09	2,290,355,236.61

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。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交易的不活跃品种（企业债或短期融资券）来实现。本基金能够通过出售所持有的债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（若有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金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。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过债券回购业务借入短期资金应对流动性需求，债券正回购的资金余额不超过基金资产净值的 20%。

本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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	1,828,643,350.23	-	-	-	1,828,643,350.23
结算备付金	5,556,095.66	-	-	-	5,556,095.66
交易性金融资产	2,601,914,619.21	-	-	-	2,601,914,619.21
买入返售金融资产	1,685,207,465.53	-	-	-	1,685,207,465.53
应收申购款	-	-	-	92,893.26	92,893.26
其他资产	-	-	-	-1,152,980.02	-1,152,980.02
资产总计	6,121,321,530.63	-	-	-1,060,086.76	6,120,261,443.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	97,975.96	97,975.96
应付管理人报酬	-	-	-	743,163.31	743,163.31

应付托管费	-	-	-	247,721.04	247,721.04
卖出回购金融资产款	100,003,561.64	-	-	-	100,003,561.64
应付销售服务费	-	-	-	53,048.34	53,048.34
应付利润	-	-	-	224,482.44	224,482.44
应交税费	-	-	-	28,236.96	28,236.96
其他负债	-	-	-	170,413.91	170,413.91
负债总计	100,003,561.64	-	-	1,565,041.96	101,568,603.60
利率敏感度缺口	6,021,317,968.99	-	-	-2,625,128.72	6,018,692,840.27
上年度末 2025 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	1,117,392,341.11	-	-	-	1,117,392,341.11
交易性金融资产	2,441,387,533.14	-	-	-	2,441,387,533.14
买入返售金融资产	1,743,386,336.29	-	-	-	1,743,386,336.29
应收申购款	-	-	-	50,646,649.64	50,646,649.64
资产总计	5,302,166,210.54	-	-	50,646,649.64	5,352,812,860.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,608.58	13,608.58
应付管理人报酬	-	-	-	538,753.85	538,753.85
应付托管费	-	-	-	179,584.58	179,584.58
卖出回购金融资产款	589,022,940.10	-	-	-	589,022,940.10
应付销售服务费	-	-	-	41,160.96	41,160.96
应付利润	-	-	-	206,298.85	206,298.85
应交税费	-	-	-	13,340.73	13,340.73
其他负债	-	-	-	152,516.58	152,516.58
负债总计	589,022,940.10	-	-	1,145,264.13	590,168,204.23
利率敏感度缺口	4,713,143,270.44	-	-	49,501,385.51	4,762,644,655.95

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,703,898.68	1,579,219.07
	市场利率上升 25 个基点	-1,699,822.52	-1,576,648.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金无其他价格风险敞口。

6.4.13.4.4 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	2,601,914,619.21	2,441,387,533.14
第三层次	-	-
合计	2,601,914,619.21	2,441,387,533.14

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	2,601,914,619.21	42.51
	其中：债券	2,601,914,619.21	42.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,685,207,465.53	27.53
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	1,833,046,465.87	29.95
4	其他各项资产	92,893.26	0.00
5	合计	6,120,261,443.87	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	8.51	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	100,003,561.64	1.66
	其中：买断式回购融资	—	—

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	43
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	65.90	1.66
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天（含）—60 天	10.61	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天（含）—90 天	6.79	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天（含）—120 天	7.62	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天（含）—397 天（含）	10.71	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—

合计	101.64	1.66
----	--------	------

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	321,090,478.12	5.33
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,280,824,141.09	37.90
8	其他	-	-
9	合计	2,601,914,619.21	43.23
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	112610084	26 兴业银行 CD084	3,000,000	299,481,121.39	4.98
2	112515166	25 民生银行 CD166	2,000,000	199,952,944.16	3.32
3	112694579	26 广州农村商业银行 CD042	2,000,000	199,117,164.97	3.31
4	112517235	25 光大银行 CD235	2,000,000	199,042,300.27	3.31
5	012680911	26 象屿股份 SCP003	1,000,000	100,278,846.77	1.67
6	012681050	26 厦国贸 SCP012	1,000,000	100,238,793.92	1.67
7	112621011	26 渤海银行 CD011	1,000,000	99,943,869.77	1.66
8	112505307	25 建设银行 CD307	1,000,000	99,865,433.31	1.66

9	112603114	26 农业银行 CD114	1,000,000	99,795,412.63	1.66
10	112603127	26 农业银行 CD127	1,000,000	99,774,423.12	1.66

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0218%
报告期内偏离度的最低值	0.0098%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0160%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

26 兴业银行 CD084（代码：112610084）

2025 年 12 月 5 日，金融监管总局对兴业银行外包机构管理不到位、企业划型不准确等，罚款 720 万元。

25 民生银行 CD166（代码：112515166）

2025 年 12 月 31 日，国家金融监督管理总局宁波监管局对民生银行相关贷款、投资业务管理不审慎，相关资产减值计提不审慎，罚款 220 万元。

2025 年 10 月 31 日，金融监管总局对民生银行相关贷款、票据、同业等业务管理不审慎，监管数据报送不合规等，罚款 5865 万元。

2025 年 9 月 12 日，金融监管总局对民生银行系统使用管控不到位、基础软件版本管理不足、生产运维管理不严等，罚款 590 万元。

25 光大银行 CD235（代码：112517235）

2025 年 10 月 29 日，国家外汇管理局北京市分局对光大银行办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务，没收违法所得，罚款，罚没款金额 428.43 万元。

2025 年 9 月 12 日，金融监管总局对光大银行信息科技外包管理存在不足、监管数据错报等事项，罚款 430 万元。

25 建设银行 CD307（代码：112505307）

2026 年 6 月 5 日，金融监管总局对建设银行重要信息系统投产变更风险管控不到位、重要信息系统应急管理不足等，对建设银行罚款 70 万元。

2026 年 2 月 12 日，中国人民银行对建设银行违反账户管理规定；违反特约商户管理规定；违反人民币流通管理规定；违反反假货币业务管理规定；占压财政存款或资金；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；未按规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易，警告，没收违法所得 55.097567 万元，罚款 4295.51 万元，合计罚没 4350.607567 万元。

2025 年 9 月 12 日，金融监管总局对建设银行个别信息系统开发测试不充分、信息科技外包管理存在不足等事项，罚款 290 万元。

26 农业银行 CD114（代码：112603114）、26 农业银行 CD127（代码：112603127）

2025 年 10 月 31 日，金融监管总局对农业银行相关产品销售、服务收费不合规，信贷资金流向管理不审慎等，罚款 2720 万元。

本基金投资 26 兴业银行 CD084、25 民生银行 CD166、25 光大银行 CD235、25 建设银行 CD307、26 农业银行 CD114、26 农业银行 CD127 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金除 26 兴业银行 CD084、25 民生银行 CD166、25 光大银行 CD235、25 建设银行 CD307、26 农业银行 CD114、26 农业银行 CD127 外，投资的前十大证券的发行主体本期没有出现监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责和处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	92,893.26
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	92,893.26
---	----	-----------

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
中航航行宝 A	6,001	4,888.70	4,767,021.39	16.25	24,570,096.72	83.75
中航航行宝 B	40	149,733,893.05	5,980,896,232.43	99.86	8,459,489.73	0.14
合计	6,041	996,307.37	5,985,663,253.82	99.45	33,029,586.45	0.55

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	其他机构	2,134,147,153.18	35.46
2	券商类机构	500,000,000.00	8.31
3	银行类机构	401,292,629.48	6.67
4	其他机构	300,060,666.16	4.99
5	其他机构	300,000,000.00	4.98
6	银行类机构	201,051,968.78	3.34
7	银行类机构	200,683,513.30	3.33
8	银行类机构	200,104,075.28	3.32
9	保险类机构	152,749,455.54	2.54
10	保险类机构	145,577,653.67	2.42

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	中航航行宝 A	253,736.48	0.86
	中航航行宝 B	0.00	—
	合计	253,736.48	0.00

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	中航航行宝 A	0~10
	中航航行宝 B	—
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中航航行宝 A	0~10
	中航航行宝 B	—
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航航行宝 A	中航航行宝 B
基金合同生效日 （2017 年 1 月 25 日） 基金份额总额	520,655,938.43	—
本报告期期初基金份额总额	49,772,402.28	4,712,872,253.67
本报告期基金总申购份额	167,509,065.27	9,540,477,152.89
减：本报告期基金总赎回份额	187,944,349.44	8,263,993,684.40
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	29,337,118.11	5,989,355,722.16

注：本期申购含基金红利再投、转换入、级别调整入份额；本期赎回含基金转换出、级别调整出份额。

§ 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. 本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
2. 2026 年 2 月 4 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 2026 年 2 月 2 日起，宋鑫担任公司督察长职务，刘建不再担任公司督察长职务。

3. 2026 年 4 月 24 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 2026 年 4 月 22 日起，王楠担任公司副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受到调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、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 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰海通证券股份有限公司	400,079,369.86	100.00	3,600,000,000.00	100.00	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内本基金不存在偏离绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中航航空宝货币市场基金更新的招募说明书（2026 年第 1 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 16 日
2	中航航空宝货币市场基金基金产品资料概要更新	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 16 日
3	中航航空宝货币市场基金 2025 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	2026 年 1 月 22 日
4	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 4 日
5	中航航空宝货币市场基金 2025 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
6	中航航空宝货币市场基金 2026 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	2026 年 4 月 22 日

7	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 24 日
8	关于中航航空宝货币市场基金增加销售机构的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 8 日
9	中航基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司销售业务的公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 16 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	20260402-20260609	-	2,004,914,528.79	2,004,914,528.79	-	0.00
	2	20260101-20260630	1,621,112,574.26	713,034,578.92	200,000,000.00	2,134,147,153.18	35.46
产品特有风险							
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1. 中国证监会批准中航航空宝货币市场基金募集的文件
- 2. 《中航航空宝货币市场基金基金合同》
- 3. 《中航航空宝货币市场基金托管协议》
- 4. 基金管理人业务资格批件、营业执照

5. 报告期内中航航空宝货币市场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

2026 年 8 月 29 日