

前海开源中航军工指数分级证券投资基金

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

送出日期:2021 年 03 月 31 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年4月22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。

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2020年01月01日起至2020年12月31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	8
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61
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	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
8.12 投资组合报告附注.....	62
§9 基金份额持有人信息.....	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
9.4 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.....	65
§10 开放式基金份额变动.....	65
§11 重大事件揭示.....	66
11.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4 基金投资策略的改变.....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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.....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§13 备查文件目录.....	83
13.1 备查文件目录.....	83
13.2 存放地点.....	83
13.3 查阅方式.....	83

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源中航军工指数分级证券投资基金		
基金简称	前海开源中航军工		
场内简称	中航军工		
基金主代码	164402		
基金运作方式	契约型普通开放式		
基金合同生效日	2015年03月30日		
基金管理人	前海开源基金管理有限公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,145,008,915.26份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	前海开源中 航军工A	前海开源中 航军工B	前海开源中航 军工
下属分级基金场内简称	中航军A	中航军B	中航军工
下属分级基金的交易代码	150221	150222	164402
报告期末下属分级基金的份额总额	-份	-份	1,145,008,915.26份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金紧密跟踪标的指数——中证中航军工主题指数，通过严谨数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过【0.35%】，年跟踪误差不超过【4%】。</p>
投资策略	<p>本基金采用动态复制标的指数的投资方法，参照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增</p>

发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金力争前海开源中航军工份额净值增长率与同期业绩比较基准的增长率之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略

为实现跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于非现金基金资产的90%的比例投资于标的指数成份股及其备选成份股，并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

2、股票投资策略

(1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将参照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

(2) 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对其进行适时调整，以保证前海开源中航军工份额净值增长率与标的

	<p>指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>1) 定期调整</p> <p>根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整;</p> <p>根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;</p> <p>根据法律、法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。</p>
业绩比较基准	<p>中证中航军工主题指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。</p>

	从本基金所分拆的两类基金份额来看,前海开源中航军工 A 份额为稳健收益类份额;前海开源中航军工 B 份额为积极收益类份额。		
下属分级基金的风险收益特征	前海开源中航军工A份额为稳健收益类份额。	前海开源中航军工B份额为积极收益类份额。	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司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	前海开源基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001666998	95565
传真	0755-83181169	0755-82960794
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码	518040	518000

法定代表人	王兆华	霍达
-------	-----	----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国(上海)黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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	2020年	2019年	2018年
本期已实现收益	73,621,744.08	-97,429,295.00	-1,484,945,966.45
本期利润	531,400,823.66	216,617,175.77	-855,381,609.49
加权平均基金份额本期利润	0.5134	0.2469	-0.347
本期加权平均净值利润率	51.81%	24.78%	-38.76%
本期基金份额净值增长率	69.57%	25.16%	-28.00%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	-445,170,690.59	-703,494,187.90	-679,385,117.85
期末可供分配基金份额利润	-0.3888	-0.6849	-0.6866

期末基金资产净值	1,303,957,301.46	1,037,937,332.30	828,208,009.60
期末基金份额净值	1.139	1.011	0.837
3.1.3 累计期末指标	2020年末	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	16.51%	-31.29%	-45.10%

注：① 上述基金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。

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。

③ 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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	25.58%	1.98%	22.13%	1.95%	3.45%	0.03%
过去六个月	62.03%	2.43%	58.99%	2.44%	3.04%	-0.01%
过去一年	69.57%	2.24%	67.00%	2.24%	2.57%	0.00%
过去三年	52.79%	1.89%	54.01%	1.89%	-1.22%	0.00%
过去五年	-4.50%	1.82%	-0.84%	1.79%	-3.66%	0.03%
自基金合同生效起至今	16.51%	1.79%	7.17%	2.18%	9.34%	-0.39%

注：本基金的业绩比较基准为：中证中航军工主题指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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

前海开源中航军工指数型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年03月30日-2020年12月31日)



3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于2012年12月27日经中国证监会批准，2013年1月23日注册成立，截至报告期末，注册资本为2亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司（以下简称“前海开源资管”）已于2013年9月5日在深圳市注册成立，并于2013年9月18日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为1.8亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理91只开放式基金，资产管理规模超过897亿元。

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		
黄玥	本基金的基金经理、公司投资副总监、量化投资部负责人	2017-02-21	-	17年	黄玥先生，物理学硕士。2003年7月加入南方基金管理有限公司，曾任风控策略部高级经理，数量化投资部总监助理，负责量化平台搭建，数量化研究和投资。2015年11月加盟前海开源基金管理有限公司，任投资副总监、量化投资部负责人。

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”分别指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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合投资策略需要，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价出现1次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%的情况，基金经理按规定履行了审批程序。

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

2020年A股在全球疫情及流动性极其充裕的情况下大幅波动，最终走出了结构性牛市。申万国防军工指数全年涨幅57.98%，本基金全年净值增长率69.57%，相对业绩比较基准取得了约3%的超额收益，跟踪误差3%，相对控制在较低水平。本基金目前仍有相对较大规模，报告期间积极参与新股申购，力争增强组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源中航军工基金份额净值为1.139元，本报告期内，基金份额净值增长率为69.57%，同期业绩比较基准收益率为67.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入到2021年，全球疫情在疫苗开始全面接种后进入尾声，但经济复苏的同时可能伴随货币政策的边际收紧。全球主要股市过去一年在流动性的推动下普遍经历了显著的上涨，估值普遍较高的情况下可能面临大幅波动的风险。“十四五”第一年装备采购有望延续当前的稳增态势，随着中美博弈的深入，对国防加大投入的紧迫性和确定性都很高，军工板块也有望继续维持强势。

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，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益的角度出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，我公司采取外聘律师和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(2) 本年度，我公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对信息技术、

用户权限、通信管理与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制、事后完善纠偏的方式，全面加强了对公司产品日常投资运作的管理与监控，保证投资符合既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并升级了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，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

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会、基金业协会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会由督察长、基金核算部、监察稽核部、金融工程部、交易部、投资研究部门负责人及其他指定相关人员组成。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种和流通受限股票的估值相关数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

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

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查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。

§ 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	普华永道中天审字(2021)第22274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	前海开源中航军工指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	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和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业

	实务操作编制，公允反映了前海开源中航军工基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于前海开源中航军工基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	前海开源中航军工基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估前海开源中航军工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前海开源中航军工基金、终止运营或别无其他现实的选择。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。在

	<p>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：（一）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。（二）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。（三）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。（四）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，就可能对前海开源中航军工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前海开源中航军工基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、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。我们与基金管理人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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹 施翊洲
会计师事务所的地址	中国(上海)黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼

审计报告日期	2021-03-26
--------	------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：前海开源中航军工指数分级证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	105,106,878.56	80,236,696.68
结算备付金		284,215.49	-
存出保证金		762,736.36	119,121.22
交易性金融资产	7.4.7.2	1,226,402,210.67	960,766,123.34
其中：股票投资		1,226,402,210.67	960,766,123.34
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		12,772,901.51	-
应收利息	7.4.7.5	35,835.81	68,796.35
应收股利		-	-
应收申购款		11,913,751.66	421,993.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,357,278,530.06	1,041,612,731.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日

负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		50,787,439.98	2,120,863.28
应付管理人报酬		1,014,381.52	680,025.30
应付托管费		202,876.29	136,005.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	748,360.12	291,059.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	568,170.69	447,445.55
负债合计		53,321,228.60	3,675,398.92
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,108,941,893.39	1,510,745,454.96
未分配利润	7.4.7.10	195,015,408.07	-472,808,122.66
所有者权益合计		1,303,957,301.46	1,037,937,332.30
负债和所有者权益总计		1,357,278,530.06	1,041,612,731.22

注：报告截止日2020年12月31日，前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金份额总额1,145,008,915.26份，基金份额净值1.139元。

7.2 利润表

会计主体：前海开源中航军工指数分级证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月01	上年度可比期间
-----	-----	--------------	---------

		日 至2020年12月3 1日	2019年01月01日至201 9年12月31日
一、收入		547,669,132.65	228,616,480.41
1. 利息收入		1,147,351.85	882,526.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,147,351.85	882,526.96
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		82,647,042.54	-87,197,875.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	79,788,052.88	-89,791,480.40
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.14. 5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	2,858,989.66	2,593,604.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	457,779,079.58	314,046,470.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	6,095,658.68	885,358.31
减：二、费用		16,268,308.99	11,999,304.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	10,222,122.64	8,718,367.42
2. 托管费	7.4.10.2.	2,044,424.51	1,743,673.41

	2		
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	3,437,832.92	1,092,320.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.21	563,928.92	444,943.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		531,400,823.66	216,617,175.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		531,400,823.66	216,617,175.77

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源中航军工指数分级证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,510,745,454.96	-472,808,122.66	1,037,937,332.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	531,400,823.66	531,400,823.66
三、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)	-401,803,561.57	136,422,707.07	-265,380,854.50

其中：1. 基金申购款	2,660,388,833.54	-179,985,581.77	2,480,403,251.77
2. 基金赎回款	-3,062,192,395.11	316,408,288.84	-2,745,784,106.27
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,108,941,893.39	195,015,408.07	1,303,957,301.46
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,507,593,127.45	-679,385,117.85	828,208,009.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	216,617,175.77	216,617,175.77
三、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）	3,152,327.51	-10,040,180.58	-6,887,853.07
其中：1. 基金申购款	891,576,274.66	-272,117,306.85	619,458,967.81
2. 基金赎回款	-888,423,947.15	262,077,126.27	-626,346,820.88
四、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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1, 510, 745, 454. 96	-472, 808, 122. 66	1, 037, 937, 332. 30

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：

王兆华

何隽

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

前海开源中航军工指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]140号《关于准予前海开源中航军工指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币499,806,628.45元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2015]02030024号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》于2015年3月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为499,884,548.63份基金份额,其中认购资金利息折合77,920.18份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括前海开源中航军工指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“前海开源中航军工份额”)、前海开源中航军工指数分级证券投资基金之A份额(以下简称“前海开源中航军工A份额”)及前海开源中航军工指数分级证券投资基金之B份额(以下简称“前海开源中航军工B份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售前海开源中航军工份额。投资人场外认购所得的前海开源中航军工份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的前海开源中航军工份额,将按1:1的基金份额配比自动分离为前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额。前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额的数量保持1:1的比例不变。基金合同生效后,前海开源中航军工份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内前海开源中航军工份额与前海开源中航军工A份额和前海

开源中航军工B份额之间可以按照约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每2份场内前海开源中航军工份额按照1：1的份额配比转换成1份前海开源中航军工A份额与1份前海开源中航军工B份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每1份前海开源中航军工A份额与1份前海开源中航军工B份额按照1：1的基金份额配比转换成2份场内前海开源中航军工份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：前海开源中航军工份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为前海开源中航军工份额、前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额数量的总和。本基金每份前海开源中航军工A份额与每份前海开源中航军工B份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于2份前海开源中航军工份额的基金份额净值之和。前海开源中航军工A份额的约定收益率为一年期银行定期存款利率(税后)+5%，前海开源中航军工A份额的份额净值每日按该约定收益率逐日计算，计算出前海开源中航军工A份额的基金份额参考净值后，根据前海开源中航军工份额的基金份额净值与前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出前海开源中航军工B份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算前海开源中航军工A份额的基金份额参考净值调整为1.000元，基金份额折算基准日折算前海开源中航军工A份额的基金份额参考净值超出1.000元的部分将折算为场内前海开源中航军工份额分配给前海开源中航军工A份额持有人。前海开源中航军工份额持有人持有的每2份前海开源中航军工份额将按1份前海开源中航军工A份额获得新增前海开源中航军工份额的分配。持有场外前海开源中航军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外前海开源中航军工份额的分配；持有场内前海开源中航军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内前海开源中航军工份额的分配。经过上述份额折算后，前海开源中航军工份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额的份额配比保持1：1的比例。前海开源中航军工B份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变前海开源中航军工B份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当前海开源中航军工份额的基金份额净值大于或等于1.500元时，或当前海开源中航军工B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元时，本基金可根据市场情况确定折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额的比例为1：1，份额折算后前海开源中航军工A份额的基金份额参考净值、前海开源中航军工B份额的基金份额参考净值和前海开源中航军工份额的基金份额净值均调整为1.000元。当前海开源中航军工份额的基金份额净值大于或等于1.500元时，基金份额折算基准日折算前海开源中航军工

份额的基金份额净值及前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额的基金份额参考净值超出1.000元的部分均将折算为前海开源中航军工份额分别分配给前海开源中航军工份额、前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额的持有人。当前海开源中航军工B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元时，前海开源中航军工份额、前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]140号核准同意，前海开源中航军工A份额144,033,554.00份基金份额与前海开源中航军工B份额144,033,555.00份基金份额于2015年4月20日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的前海开源中航军工份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额即可上市流通；对于托管在场外的前海开源中航军工份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额即可上市流通。

根据《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》约定，本基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止前海开源中航军工A份额与前海开源中航军工B份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2020年12月2日发布《关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额退市，并于2020年12月31日(基金折算基准日)进行基金份额折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证中航军工主题指数的成份股、备选成份股、固定收益资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、质押及买断式回购、银行存款等)、资产支持证券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)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为90-95%(其中投资于中证中航军工主题指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的90%)，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证中航军工主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

如附注7.4.1所述,本基金于2020年12月31日(基金折算基准日)进行基金份额折算,前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额将终止运作并终止上市。《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》自基金份额折算基准日次日(2021年1月1日)起失效,《前海开源中航军工指数型证券投资基金基金合同》于同一日起生效,但本基金投资范围等未发生实质变化,因此本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款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。本基金持有的其他金融负债包括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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。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，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；或者(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按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以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金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

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。

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；于处置时，其处置价格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则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

其他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则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内，本基金(包括前海开源中航军工份额、前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额)不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施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[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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，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；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	105,106,878.56	80,236,696.68
定期存款	-	-
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	-	-
合计	105,106,878.56	80,236,696.68

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	857,947,943.09	1,226,402,210.67	368,454,267.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	857,947,943.09	1,226,402,210.67	368,454,267.58
项目	上年度末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,050,090,935.34	960,766,123.34	-89,324,812.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,050,090,935.34	960,766,123.34	-89,324,812.00

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	35,364.61	68,742.75
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	127.90	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-

其他	343.30	53.60
合计	35,835.81	68,796.35

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	748,360.12	291,059.76
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	748,360.12	291,059.76

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	184,400.78	7,445.55
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	320,000.00	400,000.00
应付指数使用费	63,769.91	40,000.00
合计	568,170.69	447,445.55

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,027,106,896.11	1,510,745,454.96
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	439,093,822.30	-
本期申购	2,348,471,158.70	2,660,388,833.54
本期赎回（以“-”号填列）	-2,669,662,961.85	-3,062,192,395.11
本期末	1,145,008,915.26	1,108,941,893.39

注：

1. 本基金的基金份额包括前海开源中航军工份额、前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额。本期申购含申购的前海开源中航军工份额和配对转入的前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额，本期赎回含赎回的前海开源中航军工份额和配对转出的前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额。

2. 截至2020年12月31日止，本基金于深交所上市的基金份额为254,397,836.00份（2019年12月31日：520,733,390.00份），托管在场内未上市交易的基金份额为121,858,691.00份（2019年12月31日：48,750,982.00份），托管在场外未上市交易的基金份额为768,752,389.26份（2019年12月31日：457,622,524.11份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。前海开源中航军工份额与前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

3. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限公司的相关业务规定，本基金以2020年1月2日为基金份额折算基准日，对前海开源中航军工份额的场外份额、场内份额以及前海开源中航军工A份额实施定期份额折算。场外前海开源中航军工份额折算前份额为457,656,279.37份，新增份额折算比例为0.032679793，折算后份额为472,612,391.84份，折算后份额净值0.994元；场内前海开源中航军工份额折算前份额为48,729,974.00份，新增份额折算比例为0.032679793，折算后份额为67,339,902.00份，折算后份额净值0.994元；前海开源中航军工A份额折算前份额为260,366,445.00份，新增份额折算比例为0.065359586，折算后份额为260,366,445.00份，折算后份额净值1.000元。

4. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限公司的相关业务规定，本基金以2020年8月10日为基金份额折算基准日，对前海开源中航军工份额的场外份额、场内份额、前海开源中航军工A份额以及前海开源中航军工B份额实施了不定期份额折算。前海开源中航军工A份额折算前份额为201,372,561.00份，新增份额折算比例为0.039603825，折算后份额为209,347,684.00份，包括新增前海开源中航军工场内份额7,975,123.00份，折算后份额净值1.000元；前海开源中航军工B份额

折算前份额为201,372,561.00份，新增份额折算比例为0.901600677，折算后份额为382,930,198.00份，包括新增前海开源中航军工场内份额181,557,637.00份，折算后份额净值1.000元；场外前海开源中航军工份额折算前份额为449,216,777.83份，新增份额折算比例为0.470602251，折算后份额为660,619,204.66份，折算后份额净值1.000元；场内前海开源中航军工份额折算前份额为9,758,977.00份，新增份额折算比例为0.470602251，折算后份额为203,884,333.00份（其中包含前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额经折算后产生的新增场内前海开源中航军工份额），折算后份额净值1.000元。

5. 根据《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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》以及本基金的基金合同等相关规定，基金管理人前海开源基金管理有限公司制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案，并于2020年12月2日发布《关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，于2020年12月29日发布《关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额基金份额折算的公告》。本基金以2020年12月31日为基金份额转换基准日，将前海开源中航军工份额、前海开源中航军工A份额以及前海开源中航军工B份额转换成前海开源中航军工指数型证券投资基金的场内份额，前海开源中航军工份额的场内份额和场外份额自动转换成前海开源中航军工指数型证券投资基金的场内份额和场外份额。前海开源中航军工A份额转换前份额为127,198,918.00份，转换比例为0.900403534，转换成前海开源中航军工指数型证券投资基金的场内份额114,530,355.00份；前海开源中航军工B份额转换前份额为127,198,918.00份，转换比例为1.099596466，转换成前海开源中航军工指数型证券投资基金的场内份额139,867,480.00份，前海开源中航军工份额的场内份额和场外份额分别转换为前海开源中航军工指数型证券投资基金的场内份额121,858,691.00份和场外份额768,752,389.26份。

6. 根据本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2020年12月31日发布的《前海开源中航军工指数分级证券投资基金停止申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管及份额配对转换业务的公告》，自2020年12月31日起，前海开源中航军工份额停止办理申购、赎回、转换、定期定额投资等业务；前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额与前海开源中航军工份额停止办理份额配对转换业务。前海开源中航军工指数分级证券投资基金停止转托管业务(包括场外转托管和跨系统转托管)。

7.4.7.10 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
上年度末	-703,494,187.90	230,686,065.24	-472,808,122.66
本期利润	73,621,744.08	457,779,079.58	531,400,823.66
本期基金份额交易产生的变动数	184,701,753.23	-48,279,046.16	136,422,707.07
其中：基金申购款	-1,218,276,282.75	1,038,290,700.98	-179,985,581.77
基金赎回款	1,402,978,035.98	-1,086,569,747.14	316,408,288.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-445,170,690.59	640,186,098.66	195,015,408.07

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	1,104,842.30	875,798.50
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	16,558.53	1,749.10
其他	25,951.02	4,979.36
合计	1,147,351.85	882,526.96

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	1,380,329,619.24	427,337,484.94
减：卖出股票成本总额	1,300,541,566.36	517,128,965.34
买卖股票差价收入	79,788,052.88	-89,791,480.40

7.4.7.13 基金投资收益

无。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,858,989.66	2,593,604.77
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	2,858,989.66	2,593,604.77

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	457,779,079.58	314,046,470.77
——股票投资	457,779,079.58	314,046,470.77
——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	457,779,079.58	314,046,470.77

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	6,087,853.18	883,532.97
其他	297.21	-
转换费收入	7,508.29	1,825.34
合计	6,095,658.68	885,358.31

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	3,437,832.92	1,092,320.10
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,437,832.92	1,092,320.10

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	100,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	16,306.59	6,069.24

指数使用费	207,622.33	175,874.47
公证费	10,000.00	-
律师费	50,000.00	3,000.00
基金上市费	60,000.00	60,000.00
合计	563,928.92	444,943.71

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据前海开源基金管理有限公司于2020年12月2日发布的《关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，本基金于2020年12月31日(基金折算基准日)进行基金份额折算，前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额于2021年1月4日终止上市。《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》自基金份额折算基准日次日(2021年1月1日)起失效，《前海开源中航军工指数型证券投资基金基金合同》于同一起生效，同时本基金更名为前海开源中航军工指数型证券投资基金。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司(“前海开源基金”)	基金管理人、基金销售机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金托管人、基金销售机构
开源证券股份有限公司(“开源证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人的股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,222,122.64	8,718,367.42
其中：支付销售机构的客户维护费	1,554,213.29	872,275.70

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,044,424.51	1,743,673.41

注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2020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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本	期末估值	备注

		日		类型		单价	位：股)	总额	总额	
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	创业板打新限售	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
688668	鼎通科技	2020-12-11	2021-06-21	科创板打新限售	20.07	24.56	3,037	60,952.59	74,588.72	-
688585	上纬新材	2020-09-21	2021-03-29	科创板打新限售	2.49	12.51	4,922	12,255.78	61,574.22	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	创业板打新限售	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300900	广联航空	2020-10-19	2021-04-29	创业板打新限售	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-06-30	创业板打新限售	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	创业板打新限售	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	创业板打新限售	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
3008	狄耐	2020	2021	创业	24.8	33.5	499	12,4	16,7	-

84	克	-11-05	-05-12	板打 新限售	7	1		10.1 3	21.4 9	
3008 98	熊猫 乳品	2020 -10- 09	2021 -04- 16	创业 板打 新限售	10.7 8	33.0 3	496	5,34 6.88	16,3 82.8 8	-
3008 92	品渥 食品	2020 -09- 11	2021 -03- 30	创业 板打 新限售	26.6 6	60.0 1	272	7,25 1.52	16,3 22.7 2	-
3009 09	汇创 达	2020 -11- 11	2021 -05- 18	创业 板打 新限售	29.5 7	40.6 7	386	11,4 14.0 2	15,6 98.6 2	-
3008 87	谱尼 测试	2020 -09- 09	2021 -03- 16	创业 板打 新限售	44.4 7	74.5 2	210	9,33 8.70	15,6 49.2 0	-
3008 89	爱克 股份	2020 -09- 09	2021 -03- 16	创业 板打 新限售	27.9 7	30.1 2	479	13,3 97.6 3	14,4 27.4 8	-
3009 25	法本 信息	2020 -12- 21	2021 -06- 30	创业 板打 新限售	20.0 8	37.3 3	353	7,08 8.24	13,1 77.4 9	-
3008 95	铜牛 信息	2020 -09- 17	2021 -03- 24	创业 板打 新限售	12.6 5	45.3 0	283	3,57 9.95	12,8 19.9 0	-
3009 07	康平 科技	2020 -11- 11	2021 -05- 18	创业 板打 新限售	14.3 0	26.8 5	473	6,76 3.90	12,7 00.0 5	-

				售						
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	创业板打新限售	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	创业板打新限售	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	创业板打新限售	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	创业板打新限售	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	创业板打新限售	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
无。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于股票、债券等金融工具，在日常投资管理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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理团队和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理团队负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。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。

7.4.13.2 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。

本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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他国内大中型商业银行处，因而与银行存款相关的信用风险不重大。在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2020年12月31日，本基金未持有债券、资产支持证券和同业存单投资(2019年12月31日：同)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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在开放期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在开放期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。

于2020年12月31日，除卖出回购金融资产款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(所有者权益)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。

7.4.13.3.1 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上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2020年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。于2020年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值未超过经确认的当日净赎回金额。

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。

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未来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银行存款、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	105,106,878.56	-	-	-	105,106,878.56
结算备付金	284,215.49	-	-	-	284,215.49
存出保证金	762,736.36	-	-	-	762,736.36
交易性金融资产	-	-	-	1,226,402,210.67	1,226,402,210.67
应收证券清算款	-	-	-	12,772,901.51	12,772,901.51
应收利息	-	-	-	35,835.81	35,835.81
应收申购款	221,600.00	-	-	11,692,151.66	11,913,751.66
资产总计	106,375,430.41	-	-	1,250,903,099.65	1,357,278,530.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	50,787,439.98	50,787,439.98

应付管理人报酬	-	-	-	1,014,381.52	1,014,381.52
应付托管费	-	-	-	202,876.29	202,876.29
应付交易费用	-	-	-	748,360.12	748,360.12
其他负债	-	-	-	568,170.69	568,170.69
负债总计	-	-	-	53,321,228.60	53,321,228.60
利率敏感度缺口	106,375,430.41	-	-	1,197,581,871.05	1,303,957,301.46
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	80,236,696.68	-	-	-	80,236,696.68
存出保证金	119,121.22	-	-	-	119,121.22
交易性金融资产	-	-	-	960,766,123.34	960,766,123.34
应收利息	-	-	-	68,796.35	68,796.35
应收申购款	5,000.00	-	-	416,993.63	421,993.63
资产总计	80,360,817.90	-	-	961,251,913.32	1,041,612,731.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,120,863.28	2,120,863.28
应付管理人报酬	-	-	-	680,025.30	680,025.30
应付托管费	-	-	-	136,005.03	136,005.03
应付交易费用	-	-	-	291,059.76	291,059.76
其他负债	-	-	-	447,445.55	447,445.55
负债总计	-	-	-	3,675,398.92	3,675,398.92

计					
利率敏 感度缺 口	80,360,817.90	-	-	957,576,514.40	1,037,937,332.30

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2019年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

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化而发生波动的风险。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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,226,402,210.67	94.05	960,766,123.34	92.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,226,402,210.67	94.05	960,766,123.34	92.56

7.4.13.4.3.2 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	73,803,061.77	55,191,746.27
	业绩比较基准下降5%	-73,803,061.77	-55,191,746.27

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,225,673,541.20元，属于第二层次的余额为728,669.47元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次960,759,545.30元，第二层次6,578.04元，无第三层次)。

(ii) 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。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020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资产(2019年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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(%)
1	权益投资	1,226,402,210.67	90.36
	其中：股票	1,226,402,210.67	90.36
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	105,391,094.05	7.76
8	其他各项资产	25,485,225.34	1.88
9	合计	1,357,278,530.06	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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,200,831,624.64	92.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,723,603.06	1.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1, 225, 555, 227. 70	93. 99

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	789, 013. 66	0. 06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16, 322. 72	0. 00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25, 997. 39	0. 00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15, 649. 20	0. 00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	846,982.97	0.06
--	----	------------	------

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

8.3.1 期末指数投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600893	航发动力	1,880,342	111,598,297.70	8.56
2	002179	中航光电	1,347,033	105,459,213.57	8.09
3	000768	中航西飞	2,816,050	103,292,714.00	7.92
4	000547	航天发展	2,677,153	73,621,707.50	5.65
5	600760	中航沈飞	857,527	67,041,460.86	5.14
6	000733	振华科技	951,072	55,970,587.20	4.29
7	002389	航天彩虹	1,679,691	55,849,725.75	4.28
8	002025	航天电器	799,412	52,105,674.16	4.00
9	600316	洪都航空	802,319	45,627,881.53	3.50
10	600862	中航高科	1,412,114	42,504,631.40	3.26
11	600038	中直股份	657,658	41,241,733.18	3.16
12	300699	光威复材	449,800	40,054,690.00	3.07
13	603678	火炬电子	534,200	38,622,660.00	2.96
14	002013	中航机电	3,337,744	38,217,168.80	2.93
15	000738	航发控制	1,283,491	29,430,448.63	2.26
16	600879	航天电子	3,866,381	28,920,529.88	2.22
17	600118	中国卫星	894,189	28,775,002.02	2.21
18	600765	中航重机	1,076,144	26,903,600.00	2.06
19	600372	中航电子	1,010,066	19,847,796.90	1.52

20	002268	卫士通	1,100,570	18,379,519.00	1.41
21	600482	中国动力	957,699	17,161,966.08	1.32
22	300034	钢研高纳	450,696	16,202,521.20	1.24
23	600685	中船防务	590,776	15,702,826.08	1.20
24	600967	内蒙一机	1,228,652	14,940,408.32	1.15
25	002413	雷科防务	2,065,800	14,605,206.00	1.12
26	688122	西部超导	179,911	14,304,723.61	1.10
27	300101	振芯科技	772,950	12,459,954.00	0.96
28	600562	国睿科技	711,494	12,109,627.88	0.93
29	300726	宏达电子	160,000	11,576,000.00	0.89
30	600391	航发科技	411,074	10,626,262.90	0.81
31	600764	中国海防	260,800	9,443,568.00	0.72
32	002149	西部材料	502,400	9,188,896.00	0.70
33	600990	四创电子	183,430	8,525,826.40	0.65
34	300114	中航电测	564,042	8,432,427.90	0.65
35	600150	中国船舶	426,858	7,551,118.02	0.58
36	002935	天奥电子	236,350	6,613,073.00	0.51
37	601698	中国卫通	349,729	6,344,084.06	0.49
38	300455	康拓红外	537,229	6,301,696.17	0.48

8.3.2 期末积极投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300896	爱美客	473	285,389.28	0.02
2	300911	亿田智能	3,083	126,030.04	0.01
3	688668	鼎通科技	3,037	74,588.72	0.01
4	688585	上纬新材	4,922	61,574.22	0.00

5	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
6	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
7	300894	火星人	679	25,716.16	0.00
8	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
9	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
10	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
11	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
12	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
13	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
14	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
15	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
16	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
17	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
18	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
19	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
20	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
21	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
22	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00

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

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	002179	中航光电	75,119,226.89	7.24
2	600536	中国软件	62,158,651.67	5.99
3	000768	中航西飞	57,274,153.09	5.52
4	600893	航发动力	56,525,644.73	5.45
5	600760	中航沈飞	55,067,166.00	5.31
6	600038	中直股份	51,677,712.38	4.98
7	601989	中国重工	50,754,245.40	4.89

8	002013	中航机电	47,583,109.74	4.58
9	000547	航天发展	44,305,561.92	4.27
10	300699	光威复材	39,932,536.00	3.85
11	002025	航天电器	37,696,466.95	3.63
12	002389	航天彩虹	37,665,325.73	3.63
13	600150	中国船舶	32,947,139.26	3.17
14	000733	振华科技	32,797,486.54	3.16
15	600862	中航高科	28,479,792.44	2.74
16	600118	中国卫星	27,185,514.08	2.62
17	600879	航天电子	25,551,341.03	2.46
18	603678	火炬电子	24,791,413.45	2.39
19	002268	卫士通	22,496,466.61	2.17
20	000738	航发控制	22,033,826.11	2.12

注：买入包括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，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

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	601989	中国重工	128,759,981.73	12.41
2	002179	中航光电	68,954,170.47	6.64
3	000768	中航西飞	56,161,499.14	5.41
4	600536	中国软件	55,487,386.06	5.35
5	600760	中航沈飞	51,696,420.56	4.98
6	002405	四维图新	50,041,339.18	4.82
7	600893	航发动力	49,800,940.00	4.80
8	002465	海格通信	48,835,464.05	4.71
9	002439	启明星辰	48,614,419.70	4.68
10	000066	中国长城	48,221,591.77	4.65
11	600038	中直股份	46,447,297.19	4.47

12	002013	中航机电	46,275,817.69	4.46
13	600118	中国卫星	35,823,642.57	3.45
14	000547	航天发展	35,057,333.91	3.38
15	300699	光威复材	33,646,832.88	3.24
16	600879	航天电子	27,653,853.00	2.66
17	600150	中国船舶	26,302,333.68	2.53
18	600482	中国动力	26,111,479.16	2.52
19	002268	卫士通	24,470,596.34	2.36
20	002025	航天电器	22,949,329.62	2.21
21	002389	航天彩虹	22,247,030.57	2.14
22	000733	振华科技	22,029,113.51	2.12

注：卖出包括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，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	1,112,744,050.91
卖出股票收入（成交）总额	1,380,329,619.24

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

8.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 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没有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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	762,736.36
2	应收证券清算款	12,772,901.51
3	应收股利	-
4	应收利息	35,835.81
5	应收申购款	11,913,751.66

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,485,225.34

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300896	爱美客	285,389.28	0.02	创业板打新限售
2	688668	鼎通科技	74,588.72	0.01	科创板打新限售
3	688585	上纬新材	61,574.22	0.00	科创板打新限售
4	300919	中伟股份	37,521.10	0.00	创业板打新限售
5	300911	亿田智能	10,215.54	0.00	创业板打新限售

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

份额	持有	户均持有的	持有人结构
----	----	-------	-------

级别	人户数 (户)	基金份额	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
前海 开源 中航 军工A	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
前海 开源 中航 军工B	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
前海 开源 中航 军工	121, 938	9,390.09	325,676,218.64	28.4 4%	819,332,696.62	71.56%
合计	121, 938	9,390.09	325,676,218.64	28.4 4%	819,332,696.62	71.56%

9.2 期末上市基金前十名持有人

无。

9.3 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	前海开源中航 军工A	0.00	0.00%
	前海开源中航 军工B	0.00	0.00%
	前海开源中航 军工	6,329.00	0.0006%
	合计	6,329.00	0.0006%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.4 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	前海开源中航军工 A	0
	前海开源中航军工 B	0
	前海开源中航军工	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源中航军工 A	0
	前海开源中航军工 B	0
	前海开源中航军工	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	前海开源中航军工A	前海开源中航军工B	前海开源中航军工
基金合同生效日(2015年03月30日)基金份额总额	-	-	499,884,548.63
本报告期期初基金份额总额	260,366,695.00	260,366,695.00	1,027,106,896.11
本报告期基金总申购份额	-	-	2,348,471,158.70
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	2,669,662,961.85
本报告期基金拆分	-260,366,695.00	-260,366,695.00	439,093,822.30

变动份额			
本报告期期末基金份额总额	-	-	1,145,008,915.26

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

1、本报告期内，本基金管理人于2020年10月20日起至2020年11月16日以通讯方式组织召开了本基金的基金份额持有人大会，审议《关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，根据计票结果，本次持有人大会未达到法定召开条件，故基金份额持有人大会召开失败。

2、根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的规定，经与基金托管人协商一致，公司对本基金的基金合同进行了修改，本次修订取消本基金分级机制，并自2020年11月20日生效。

3、根据《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》约定，前海开源中航军工指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止前海开源中航军工A份额与前海开源中航军工B份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于2020年12月2日在指定媒介发布《关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请前海开源中航军工指数分级证券投资基金的两级子份额退市，并于2020年12月31日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《前海开源中航军工指数型证券投资基金基金合同》于基金折算基准日次日正式生效，《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

投资人敬请查阅基金管理人刊登在中国证监会规定媒介上的有关公告。

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

本报告期内，基金管理人重大人事变动如下：

1、本基金管理人于2020年5月6日发布公告，秦亚峰先生担任前海开源基金管理有限公司固定收益投资决策委员会主席；

2、本基金管理人于2020年9月12日发布公告，前海开源基金管理有限公司总理由蔡颖女士变更为贾红波先生；

3、本基金管理人于2020年11月25日发布公告，何隽先生担任前海开源基金管理有限公司首席信息官。

上述事项经前海开源基金管理有限公司董事会审议通过，并已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时报送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会规定的全国性报刊及规定互联网网站等媒介披露。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为10万元。该事务所自2019年11月23日起为本基金提供审计服务至今，本报告期内无改聘会计师事务所的事项。

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

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情形。

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	
天风证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

安信 证券	2	-	-	-	-	-
川财 证券	2	-	-	-	-	-
方正 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	1,351,937,022.69	54.54%	988,674.37	54.55%	-
山西 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源 西部	2	1,126,647,539.69	45.46%	823,905.82	45.45%	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
银河 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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
无。

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	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间前海开源中航军工A份额停复牌的公告	中国证监会规定媒介	2020-01-03
2	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证监会规定媒介	2020-01-06
3	关于前海开源中航军工A定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	中国证监会规定媒介	2020-01-06
4	前海开源中航军工指数分级证券投资基金2019年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2020-01-20
5	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加一路财富费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2020-01-21
6	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过珠海盈米基金销售有限公司办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-03
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参	中国证监会规定媒介	2020-03-04

	加海通证券费率优惠的公告		
8	前海开源中航军工指数分级证券投资基金招募说明书(20200320更新)	中国证监会规定媒介	2020-03-20
9	前海开源中航军工指数分级证券投资基金招募说明书摘要(20200320更新)	中国证监会规定媒介	2020-03-20
10	前海开源基金关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金暂停场内申购业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-23
11	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过安信证券办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-24
12	前海开源基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金2019年年度报告的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-24
13	前海开源基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-30
14	前海开源中航军工指数分级证券投资基金2020年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2020-04-22
15	前海开源中航军工指数分级证券投资基金2019年年度报告	中国证监会规定媒介	2020-04-25
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加万联证券费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2020-05-06
17	前海开源基金管理有限公司关于暂停扬州国信嘉利基金	中国证监会规定媒介	2020-05-28

	销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告		
18	前海开源中航军工指数分级证券投资基金2020年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2020-07-21
19	前海开源中航军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-08-05
20	前海开源中航军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-08-07
21	前海开源中航军工指数分级证券投资基金不定期份额折算公告	中国证监会规定媒介	2020-08-10
22	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间中航军A、中航军B停复牌公告	中国证监会规定媒介	2020-08-11
23	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金不定期份额折算前收盘价调整的公告	中国证监会规定媒介	2020-08-12
24	前海开源中航军工指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证监会规定媒介	2020-08-12
25	前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2020-08-27
26	前海开源中航军工指数分级证券投资基金2020年中期报告	中国证监会规定媒介	2020-08-31
27	前海开源基金管理有限公司关于终止深圳信诚基金销售有限公司代理旗下基金相关	中国证监会规定媒介	2020-09-05

	销售业务的公告		
28	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-09-30
29	关于以通讯方式召开前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-30
30	关于以通讯方式召开前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-09
31	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-09
32	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-12
33	关于以通讯方式召开前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-12
34	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-13
35	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-14
36	关于前海开源中航军工指数	中国证监会规定媒介	2020-10-15

	分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告		
37	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-16
38	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-19
39	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-20
40	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-21
41	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-22
42	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-23
43	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-26
44	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会	中国证监会规定媒介	2020-10-27

	相关事项的提示性公告		
45	前海开源中航军工指数分级证券投资基金2020年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2020-10-28
46	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-28
47	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-29
48	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-30
49	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-02
50	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-03
51	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-04
52	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-05
53	前海开源基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售	中国证监会规定媒介	2020-11-05

	有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告		
54	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-06
55	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-09
56	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-10
57	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-11
58	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-12
59	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-13
60	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-16
61	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-17

62	前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额与前海开源中航军工B份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-18
63	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-18
64	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会规定媒介	2020-11-19
65	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金整改的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-20
66	前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2020-11-20
67	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金修订基金合同的公告	中国证监会规定媒介	2020-11-20
68	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金整改的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-23
69	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金整改的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-24
70	前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金产品资料概要更新（20201124更新）	中国证监会规定媒介	2020-11-24
71	前海开源中航军工指数分级	中国证监会规定媒介	2020-11-24

	证券投资基金招募说明书(20201124更新)		
72	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金整改的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-25
73	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金整改的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-26
74	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金整改的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-27
75	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金整改的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-11-30
76	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金整改的提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-12-01
77	前海开源中航军工指数型证券投资基金基金合同(由前海开源中航军工指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来)	中国证监会规定媒介	2020-12-02
78	前海开源中航军工指数型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2020-12-02
79	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作	中国证监会规定媒介	2020-12-02

	的特别风险提示公告		
80	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-02
81	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-03
82	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-04
83	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-07
84	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-08
85	前海开源基金管理有限公司关于终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关	中国证监会规定媒介	2020-12-09

	销售业务的公告		
86	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-09
87	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-10
88	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-11
89	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-14
90	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-15
91	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开	中国证监会规定媒介	2020-12-16

	源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告		
92	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-17
93	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-18
94	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-21
95	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-22
96	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-23
97	前海开源基金管理有限公司	中国证监会规定媒介	2020-12-24

	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告		
98	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-25
99	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-28
100	前海开源中航军工指数分级证券投资基金停止申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管及份额配对转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-29
101	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额基金份额折算的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-29
102	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-30
103	前海开源基金管理有限公司	中国证监会规定媒介	2020-12-31

	关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金转型后基金名称变更的公告		
104	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中航军工指数分级证券投资基金之前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额终止运作的特别风险提示公告	中国证监会规定媒介	2020-12-31
105	前海开源基金管理有限公司关于终止与部分代销机构合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-31

§ 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

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	20200101-20200512	303,353,594.95	11,139,022.64	310,663,038.59	3,829,579.00	0.33%
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上(含)发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>单一投资者巨额赎回后，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，2020年8月7日，前海开源中航军工份额的基金份额净值为1.501元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。本基金以2020年8月10日为基准日办理了不定期份额折算业务。

投资人敬请查阅基金管理人刊登在中国证监会规定媒介上的有关公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册前海开源中航军工指数分级证券投资基金募集及变更的文件
- 2、《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《前海开源中航军工指数分级证券投资基金登记结算服务协议》
- 4、《前海开源中航军工指数分级证券投资基金托管协议》
- 5、《前海开源中航军工指数型证券投资基金基金合同》
- 6、《前海开源中航军工指数型证券投资基金托管协议》
- 7、法律意见书
- 8、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 9、基金托管人业务资格批件、营业执照

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998（免长途话费）
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司
二〇二一年三月三十一日