

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证中航军 A 份额和前海开源中证中航军 B 份额折算结果的公告

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》和《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，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”）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”）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》、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》。

根据上述公告，基金管理人以 2020 年 12 月 31 日为基金份额折算基准日，对在该日登记在册的前海开源中航军工 A 份额（基金代码：150221，场内简称“中航军 A”）和前海开源中航军工 B 份额（基金代码：150222，场内简称“中航军 B”）办理折算并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外份额转换成前海开源中航军工指数型证券投资基金的场外份额，现将结果公告如下：

一、基金份额转换结果

以基金份额折算基准日前海开源中航军工份额的基金份额净值为基准，中航军 A、中航军 B 按照各自的基金份额参考净值折算并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。基金份额转换比例保留至小数点后第 9 位，小数点第 9 位以后的部分四舍五入。中航军 A、中航军 B 折算转换后的份额数保留至整数位，不足 1 份的零碎份额的处理方式按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规则处理，转换后的基金份额以登记结算机构最终确认的数据为准。有关中航军 A、中航军 B 基金份额折算转换结果如下表所示：

转换前的基金份额	转换前基金份额参考净值（元）	转换前基金份额数（份）	转换比例	转换后的基金份额	转换后基金份额数（份）
----------	----------------	-------------	------	----------	-------------

中航军 A	1.025	127,198,918.00	0.900403534	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
中航军 B	1.252	127,198,918.00	1.099596466	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

前海开源中航军工份额的场内份额、场外份额分别自动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、场外份额，如下表所示：

转换前的基金份额	转换前基金份额数（份）	转换后的基金份额	转换后基金份额数（份）
前海开源中航军工份额的场内份额	121,858,691.00	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
前海开源中航军工份额的场外份额	768,752,389.26	前海开源中航军工指数型证券投资基金的场外份额	768,752,389.26

二、重要提示

（一）《前海开源中航军工指数型证券投资基金基金合同》、《前海开源中航军工指数型证券投资基金托管协议》自 2021 年 1 月 1 日起生效，原《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》、《前海开源中航军工指数分级证券投资基金托管协议》自同日起失效。自新合同生效后，本基金的基金名称由“前海开源中航军工指数分级证券投资基金”变更为“前海开源中航军工指数型证券投资基金”，前海开源中航军工指数型证券投资基金场外简称不变，仍为“前海开源中航军工”；场内简称不变，仍为“中航军工”；基金代码不变，仍为“164402”。

（二）根据相关公告，自 2021 年 1 月 5 日起，前海开源中航军工指数型证券投资基金开始办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管（包括场外转托管和跨系统转托管）等相关业务。

前海开源中航军工指数型证券投资基金基金份额的申购费率、赎回费率具体如下：

1、申购费率

（1）场外申购费率

申购金额 M（万元） （含申购费）	申购费率
----------------------	------

$M < 50$	1.20%
$50 \leq M < 250$	0.80%
$250 \leq M < 500$	0.40%
$M \geq 500$	每笔 1,000 元

注：部分销售机构如实行优惠费率，请投资人参见销售机构公告。

(2) 场内申购费率

场内申购费率参照场外销售机构申购费率执行。

2、赎回费率

(1) 场外赎回费率

持有期限 D(天)	赎回费率
$D < 7$	1.50%
$7 \leq D < 365$	0.50%
$365 \leq D < 1095$	0.20%
$D \geq 1095$	0

2) 场内赎回费率

持有期限 D (天)	赎回费率
$D < 7$	1.50%
$D \geq 7$	0.50%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产，对持续持有期大于等于 7 日的基金份额持有人收取的赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

根据有关业务规则，基金份额持有人持有的前海开源中航军工份额转换为前海开源中航军工指数型证券投资基金基金份额后，其原基金份额持有期计入前海开源中航军工指数型证券投资基金基金份额的持有期；基金份额持有人持有的中航军 A 和中航军 B 转换为前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额后，基金份额持有期自前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额确认之日起计算，基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时

间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

（三）风险提示

1、中航军 A 和中航军 B 转换后风险收益特征发生较大变化的风险

中航军 A 表现为低风险、预期收益相对稳定的特征，分级运作期内按基金合同约定获得相应年基准收益率，但在份额转换后，中航军 A 持有人原持有的较低风险收益特征的中航军 A 将变为较高风险收益特征的前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。由于前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额为跟踪中证中航军工主题指数的基金份额，无约定年基准收益率的相关安排，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原中航军 A 持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

中航军 B 具有一定的杠杆属性，表现为高风险、预期收益相对较高的特征，但在份额转换后，中航军 B 持有人原持有的中航军 B 将变为较高风险收益特征的前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。由于前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额为跟踪中证中航军工主题指数的基金份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原中航军 B 持有人将无法继续享有杠杆安排且仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、中航军 A 和中航军 B 的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化的风险

以前海开源中航军工份额在基金份额转换基准日日终的基金份额净值为基准，中航军 A 和中航军 B 均按各自的基金份额参考净值转换为前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额，并进行取整计算（最小单位为 1 份），因此中航军 A 和中航军 B 的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化。

此外，由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人面临其所持基金资产净值减小的风险，对于持有份额数极少的中航军 A、中航军 B 持有人，面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

3、中航军 A 和中航军 B 转换为前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额后部分投资者可能无法直接办理场内赎回的风险

中航军 A 和中航军 B 转换为前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售资格或其他原因无法直接办理场内赎回，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

4、中航军 A 和中航军 B 转换为前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额后自确认之日起计算及收取赎回费的风险

根据有关业务规则，中航军 A 和中航军 B 转换为前海开源中航军工指数型证券投资基金场内份额后，基金份额持有期自份额确认之日起计算，基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

5、在前海开源中航军工指数型证券投资基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可以根据情况或者需要决定是否上市，在前海开源中航军工指数型证券投资基金上市交易之前，投资者将无法进行基金份额的上市交易，存在一定的流动性风险。

投资者欲了解详细情况，请拨打前海开源基金管理有限公司客户服务电话 4001-666-998 或登录本公司网站（www.qhkyfund.com）获取相关信息。

风险提示：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，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告

前海开源基金管理有限公司

2021年1月5日