

# 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

根据《前海开源中航军工指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关规定，当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”）之基础份额的基金份额净值达到 1.500 元时，前海开源中航军工指数分级证券投资基金之基础份额（基金简称：前海开源中航军工，场内简称：中航军工，基金代码：164402）、前海开源中航军工指数分级证券投资基金之 A 份额（基金简称：前海开源中航军工 A，场内简称：中航军 A，基金代码：150221）、前海开源中航军工指数分级证券投资基金之 B 份额（基金简称：前海开源中航军工 B，场内简称：中航军 B，基金代码：150222）将进行不定期份额折算。

由于本基金近期跟踪标的指数上涨，截至上一交易日收盘，前海开源中航军工的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件，因此，基金管理人敬请投资者密切关注前海开源中航军工近期的净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险，基金管理人特别提示如下：

一、由于中航军 A、中航军 B 折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，中航军 A、中航军 B 的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

二、中航军 B 表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阈值当日，中航军工的净值可能已高于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，此折算基准日中航军工的净值可能与折算阈值 1.500 元有一定差异。

四、中航军 A 表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后中航军 A 持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征中航军 A 变为同时持有较低风险收益特征中航军 A 与较高风险收益特征中航军工的情况，因此，中航军 A 持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

基金管理人的其他重要提示如下：

一、根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，本基金将在 2020 年底前完成规范整改，投资者如果高溢价买入中航军 B，可能遭受重大损失，请理性投资。

二、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算(最小单位为 1 份)，舍去部分计入基金资产，持有极小数量中航军工、中航军 A、中航军 B 的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

三、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停中航军 A 份额与中航军 B 份额的上市交易和中航军工份额的申购及赎回等相关业务。届时基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《前海开源中航军工指数分级证券投资基金招募说明书》（更新）（以下简称“招募说明书”）或者拨打基金管理人客服电话：4001-666-998（免长途话费）。

四、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。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告

前海开源基金管理有限公司

2020 年 8 月 7 日