

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

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》”）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之 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2018 年 2 月 5 日，本基金前海开源中航军工 B 份额的基金份额参考净值为 0.242 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2018 年 2 月 6 日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2018 年 2 月 6 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的前海开源中航军工份额（场内简称：中航军工，基金代码：164402）、前海开源中航军工 A 份额（场内简称：中航军 A，基金代码：150221）、前海开源中航军工 B 份额（场内简称：中航军 B，基金代码：150222）。

三、基金份额折算方式

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 份额按照《基金合同》“第二十一部分、基金份额的折算”规则进行不定期份额折算。

当达到不定期折算条件时，本基金将分别对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 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保前海开源中航军工 A 份额与前海开源中航军工 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后前海开源中航军工份额的基金份额净值、前海开源中航军工 A 份额与前海开源中航军工 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。具体折算原则及公式如下：

1) 前海开源中航军工 B 份额

份额折算前后前海开源中航军工 B 份额所对应的基金资产净值不变，即

$$NUM_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期后}} = \frac{NUM_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前海开源中航军工 B 份额的份额数，

$NAV_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前海开源中航军工 B 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后前海开源中航军工 B 份额的份额数。

2) 前海开源中航军工 A 份额

①份额折算后前海开源中航军工 A 份额与前海开源中航军工 B 份额的份额数保持 1: 1 配比，即

$$\begin{aligned} NUM_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期后}} &= NUM_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期后}} \\ &= \frac{NUM_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期前}}}{1.000} \\ &= \frac{NUM_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期前}}}{1.000} \end{aligned}$$

其中，

$NUM_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前海开源中航军工 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后前海开源中航军工 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{前海开源中航军工B份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后前海开源中航军工 B 份额的份额数。

②份额折算前海开源中航军工 A 的持有人在份额折算后将持有前海开源中航军工 A 份额与新增场内前海开源中航军工份额，且所对应的基金资产净值不变。

前海开源中航军工 A 份额持有人新增的场内前海开源中航军工份额的份额数为

$$NUM_{\text{前海开源中航军工份额}}^{\text{不定期新增}} = \frac{NUM_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期前}} - NUM_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前海开源中航军工 A 份额的份额数，

$NAV_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不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，

$NUM_{\text{前海开源中航军工A份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后前海开源中航军工 A 份额的份额数。

3) 前海开源中航军工份额

前海开源中航军工份额持有人份额折算前后所持有的前海开源中航军工份额的资产净

值不变。场外前海开源中航军工份额持有人份额折算后获得新增场外前海开源中航军工份额，场内前海开源中航军工份额持有人份额折算后获得新增场内前海开源中航军工份额。

前海开源中航军工份额持有人不定期份额折算后的前海开源中航军工份额的份额数为

$$NUM_{\text{前海开源中航军工份额}}^{\text{不定期后}} = \frac{NUM_{\text{前海开源中航军工份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{前海开源中航军工份额}}^{\text{不定期前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{前海开源中航军工份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前海开源中航军工份额的份额数，

$NAV_{\text{前海开源中航军工份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前海开源中航军工份额的基金份额净值，

$NUM_{\text{前海开源中航军工份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后前海开源中航军工份额的份额数。

折算后，场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产；场内基金份额的份额数计算结果保留到整数位，余额的处理方法按照深圳证券交易所或基金注册登记机构的相关规则及有关规定执行。

四、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算日，前海开源中航军工份额的基金份额净值、前海开源中航军工 A 份额与前海开源中航军工 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，前海开源中航军工份额的基金份额净值、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均调整为 1.000 元，则各持有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 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	份额净值/ 份额参考净值	份额数	份额净值/ 份额参考净值	份额数
前海开源中航军工份额	0.617 元	10,000 份	1.000 元	6,170 份前海开源中航军工份额
前海开源中航军工 A 份额	1.028 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份前海开源中航军工 A 份额 + 8,220 份前海开源中航军工份额
前海开源中航军工 B 份额	0.206 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份前海开源中航军工 B 份额

五、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 不定期份额折算基准日(即2018年2月6日),本基金暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管(包括系统内转托管、跨系统转托管,下同)、配对转换业务。前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额将于2018年2月6日上午开市至10:30停牌,并于2018年2月6日上午10:30复牌。当日晚间,基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

(二) 不定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2018年2月7日),本基金暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务,前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额暂停交易。当日,本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

(三) 不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2018年2月8日),基金管理人将公告份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内的基金份额。当日,本基金恢复办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务,前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额正常交易。

(四) 根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,2018年2月8日前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额即时行情显示的前收盘价为2018年2月7日的前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额的基金份额参考净值(四舍五入至0.001元),2018年2月8日当日前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

六、重要提示

1、前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额将于2018年2月6日上午开市至10:30停牌,并于2018年2月6日上午10:30复牌。前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额将于2018年2月7日全天停牌,2018年2月8日上午开市复牌。

2、2018年2月5日,前海开源中航军工B份额的基金份额参考净值已跌至0.250元以下,而折算基准日为2018年2月6日,因此折算基准日前海开源中航军工B份额的基金份额参考净值与折算条件0.250元可能有一定差异。

3、特别提示:近日前海开源中航军工B份额二级市场交易价格存在折价,不定期份额折算后,前海开源中航军工B份额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前海开源中航军工B份额折溢价交易所带来的风险。

4、前海开源中航军工A份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征,但在不定期份额

折算后前海开源中航军工A份额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的前海开源中航军工A份额变为同时持有较低风险收益特征的前海开源中航军工A份额与较高风险收益特征的前海开源中航军工B份额，因此原前海开源中航军工A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，前海开源中航军工份额为跟踪中证中航军工主题指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原前海开源中航军工A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、前海开源中航军工B份额表现为高风险、高收益预期的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的2倍杠杆水平，相应地，前海开源中航军工B份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

6、原前海开源中航军工A份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内前海开源中航军工份额分拆为前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额。

7、根据深圳证券交易所的相关业务规则，前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额、前海开源中航军工份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算(最小单位为1份)，舍去部分计入基金财产，持有极小数量前海开源中航军工A份额、前海开源中航军工B份额、前海开源中航军工份额的持有人，存在折算后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

8、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买前海开源中航军工A份额，在不定期份额折算后，则折算新增的前海开源中航军工份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将前海开源中航军工A份额卖出，或者在折算后将新增的前海开源中航军工份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

9、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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书及更新等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.qhkyfund.com或者拨打本公司客服电话：4001-666-998(免长途话费)。

特此公告。

前海开源基金管理有限公司

2018年2月6日