

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

编制日期：2020年08月18日

送出日期：2020年08月27日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	前海开源中航军工	基金代码	164402
基金简称A	前海开源中航军工A	基金代码A	150221
基金简称B	前海开源中航军工B	基金代码B	150222
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
基金合同生效日	2015年03月30日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所2015年04月20日
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	契约型普通开放式	开放频率	每个工作日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
黄玥	2017年02月21日		2003年07月01日

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

详见《前海开源中航军工指数分级证券投资基金招募说明书》第九章“基金的投资”。

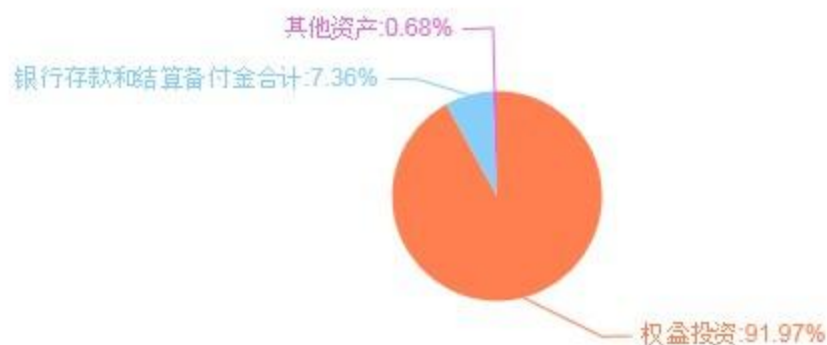
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数——中证中航军工主题指数，通过严谨数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过【0.35%】，年跟踪误差不超过【4%】。
投资范围	本基金投资于良好流动性的金融工具，包括中证中航军工主题指数的成份股、备选成份股、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、质押及买断式回购、银行存款等）、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金所持有的股票市值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%；同时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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
主要投资策略	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。

	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%。 本基金的投资策略主要有以下三方面内容：1、资产配置策略。2、股票投资策略。3、债券投资策略。
业绩比较基准	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%
风险收益特征	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。
风险收益特征A	前海开源中航军工A份额为稳健收益类份额。
风险收益特征B	前海开源中航军工B份额为积极收益类份额。

注：不同的销售机构采用的评价方法不同，本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能存在不一致的风险，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：20200630



（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2019年12月31日



注：本基金的基金合同于2015年03月30日生效，2015年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

前海开源中航军工

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M<50万	1.20%	
	50万≤M<250万	0.80%	
	250万≤M<500万	0.40%	
	500万≤M	1000元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	场内份额
	7天≤N	0.50%	场内份额
	N<7天	1.50%	场外份额
	7天≤N<365天	0.50%	场外份额
	365天≤N<1095天	0.20%	场外份额
	1095天≤N	0	场外份额

前海开源中航军工A

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前			该类基金份额

收费)			额不开通申购业务
赎回费			该类基金份额不开通赎回业务

前海开源中航军工B

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)			该类基金份额不开通申购业务
赎回费			该类基金份额不开通赎回业务

注：场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.00%
托管费	0.20%
审计费用	按协议金额计提支付
信息披露费	按协议金额计提支付
指数使用费	按协议金额计提支付
上市年费	按协议金额计提支付

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、与本基金相关的银行汇划费、账户维护费、开户费、律师费等其他费用，按实际发生金额从基金资产扣除。

四、 风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金的特定风险

(1) 作为指数基金存在的风险

1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2) 标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3) 标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据《基金合同》规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

4) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离。

(2) 作为上市基金存在的风险

1) 暂停上市或终止上市的风险

在《基金合同》生效且本基金符合上市交易条件后，前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额通过份额配对转换转为前海开源中航军工份额并转托管至场外后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

2) 基金份额折溢价的风险

本基金前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额在证券交易所的交易价格可能不同于基金份额净值，从而产生折价或者溢价的情况，虽然份额配对转换套利机制设计已将基金份额折溢价的风险降至较低水平，但是该制度不能完全规避该风险的存在。

(3) 作为分级基金存在的风险

1) 分级机制风险

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。但由于本基金存在分拆的两类基金份额，分级机制令两类基金份额具有不同的风险收益特征，从而带来不同于跟踪标的指数的指数基金的风险：前海开源中航军工A份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；前海开源中航军工B份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

2) 份额折算风险

①本基金份额折算时，投资者所持基金份额可能发生变化，形成与之前所持基金份额组合不同的风险收益特征，从而产生风险；

②本基金份额折算时，场外份额数保留至小数点后两位，场内份额数保留至整数位，剩余部分舍弃并计入基金资产。该尾差处理原则可能给投资者带来损失，从而产生风险；

③当投资者通过不具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位买卖基金份额时，可能无法赎回份额折算后新增的基金份额，从而产生风险。

3) 配对转换风险

配对转换业务的办理可能改变前海开源中航军工A份额和前海开源中航军工B份额的市场供求关系，影响基金份额的交易价格，从而产生风险；该业务也可能出现暂停办理或申请无法确认的情形，从而产生风险。

4) 基金的收益分配风险

投资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

2、市场风险。3、管理风险。4、操作风险。5、流动性风险。6、信用风险。7、本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。8、其他风险。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方当事人均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.qhkyfund.com][客服电话：4001-666-998]

●《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》、《前海开源中航军工指数分级证券投资基金招募说明书》

- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

六、 其他情况说明

无。