安信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开安信中证一带一路主题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

安信基金管理有限责任公司（以下简称"本基金管理人"）已于2020年9月25日在《证券时报》及安信基金管理有限责任公司网站（www.essencefund.com）发布了《安信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开本次会议的第一次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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》等法律法规的有关规定及《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称"基金合同"）的约定，经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（基金代码：167503，A类150275，B类150276，以下简称"本基金"）的基金管理人安信基金管理有限责任公司（以下简称"基金管理人"或"本公司"）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。会议的具体安排如下：

（一）会议召开方式：通讯方式

（二）会议投票表决起止时间：自2020年10月16日起，至2020年10月28日17:00止（送达时间以表决票收件人收到表决票的时间为准）。

（三）会议计票日：2020年10月29日

（四）会议通讯表决票的寄达地点：

1、收件人名称：安信基金管理有限责任公司
收件地址：深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
联系人：江程
联系电话：0755-82509999

2、收件人名称：北京市长安公证处
收件地址：北京市东城区朝阳门北大街6号首创大厦七层
联系人：武军
联系电话：15601290108

请在信封表面标注："安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用"。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话4008-088-088（免长途话费）咨询。

二、会议审议事项

本次基金份额持有人会议审议事项为《关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改方案说明书》（见附件二）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年10月16日，即在2020年10月16日交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金全体基金份额持有人或其授权的代理人均有权参与本次基金份额持有人大会的表决。

四、表决票的填写和寄交方式

（一）本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件三或登录本基金管理人网站（http://www.essencefund.com）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）下载并打印表决票。

（二）基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

1、个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

2、机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或经授权的业务章，下同），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

3、个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件四）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

4、机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（参照附件四）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

5、以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

（三）基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2020年10月16日起，至2020年10月28日17:00以前（送达时间以表决票收件人收到表决票的时间为准）通过专人送交、快递或邮寄的方式送达至本公告规定的收件人处，并请在信封表面注明："安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用"。

1、收件人名称：安信基金管理有限责任公司
收件地址：深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
联系人：江程
联系电话：0755-82509999

2、收件人名称：北京市长安公证处
收件地址：北京市东城区朝阳门北大街6号首创大厦七层
联系人：武军
联系电话：15601290108

五、计票

（一）本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（招商证券股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期（即2020年10月28日）后2个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（二）基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

（三）表决票效力的认定如下：

1、表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2、如表决票上的表决意见未选、多选、错填或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按"弃权"计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

3、如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

4、基金份额持有人或其代理人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；

如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

（1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

（2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

（3）送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以指定联系地址收到的时间为准。

六、决议生效条件

（一）如提交有效表决票的安信一带一路份额、安信一带一路A份额、安信一带一路B份额的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额不小于在权益登记日各自基金份额类别总份额的二分之一（含二分之一），则本次通讯开会视为有效。

（二）《关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》应当由提交有效表决意见的安信一带一路份额、安信一带一路A份额、安信一带一路B份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

（三）本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起5日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

七、本次大会相关机构

（一）召集人：安信基金管理有限责任公司
联系地址：深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
联系人：江程
联系电话：0755-82509999
传真：0755-82799292
客户服务电话：4008-088-088
网址：www.essencefund.com

（二）监督人：招商证券股份有限公司
联系地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号
联系人：韩鑫普
联系电话：0755-26951111

（三）公证机关：北京市长安公证处
联系地址：北京市东城区朝阳门北大街6号首创大厦七层
联系人：武军
联系电话：15601290108
邮政编码：100010

（四）见证律师事务所：上海市通力律师事务所
联系地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
联系电话：021-31358666

八、重要提示

（一）如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将按照中国人民银行、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》的要求于2020年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将安信一带一路A份额与安信一带一路B份额按照基金份额参考净值转换为安信一带一路份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

（二）请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

（三）安信一带一路A份额（基金代码：150275，场内简称：一带一A）及安信一带一路B份额（基金代码：150276，场内简称：一带一B）将自基金份额持有人大会计票日（2020年10月29日）开市起停牌，并将于基金份额持有人大会决议生效公告日上午10:30复牌。如基金份额持有人大会决议生效公告日为非交易日，则下一交易日开市复牌。

（四）本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电客户服务热线400-808-8088咨询。

（五）基金管理人将在发布本提示性公告后，在下个工作日连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

（六）本通知的有关内容由安信基金管理有限责任公司负责解释。

安信基金管理有限责任公司
2020年9月28日

附件一：《关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》

附件二：《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改方案说明书》

附件三：《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件四：《授权委托书》

附件一：

关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案

安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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》等法律法规的有关规定及《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，基金管理人安信基金管理有限责任公司（以下简称"基金管理人"或"本公司"）提议以通讯方式召开安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称"本基金"）的基金份额持有人大会，审议本基金转型及基金合同修改事宜，将基金名称变更为"安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）"，取消原分级运作机制，并对本基金的投资范围、投资策略、投资限制、基金估值、基金费用、基金收益与分配、争议解决方式等内容进行调整。《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改方案说明书》见附件二。

为实施本基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改方案说明书》的有关内容对《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》、《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》等相关法律文件进行相应的修改，并根据《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改方案说明书》相关内容对安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金实施转型。

以上议案，请予审议。

安信基金管理有限责任公司

附件二：

安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改方案说明书

一、声明

安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证监会证监许可[2015]770号文批准，《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》于2015年5月14日生效，安信基金管理有限责任公司（以下简称"基金管理人"）为本基金的基金管理人，招商证券股份有限公司（以下简称"基金托管人"）为本基金的基金托管人。

为更好的维护基金份额持有人利益，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》等法律法规的有关规定及《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"）的有关约定，经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，基金管理人提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，将"安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金"转型为"安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）"，并对《基金合同》进行修订。

本次《关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》应当经参加大会的安信一带一路份额、安信一带一路A份额、安信一带一路B份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，故本次转型的议案存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，本基金管理人自通过之日起5日内报中国证监会备案。本次基金份额持有人大会决议生效后，安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、转出或者卖出）。中国证监会对本次安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、调整方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由"安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金"变更为"安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）"。

（二）取消设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制

安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金拟转型为安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF），转型后取消分级运作机制，不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制内容。

（三）基金份额的终止上市

本基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人在本次基金份额持有人大会决议生效后，按照深圳证券交易所的业务规则申请办理安信一带一路A份额和安信一带一路B份额的终止上市等相关业务。

（四）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排不少于20个工作日的转型选择期，以供基金份额持有人做出赎回、转出、卖出等选择，具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。基金份额持有人在安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金正式转型前，可选择卖出安信一带一路A份额、安信一带一路B份额、或将安信一带一路A份额、安信一带一路B份额配对转换为安信一带一路份额再申请赎回，或赎回、转出安信一带一路份额等方式退出。

对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的安信一带一路份额、安信一带一路A份额与安信一带一路B份额将最终转换为安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的基金份额。

在选择期期间选择赎回的，适用安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

在选择期期间，由于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出或调整赎回方式等。

（五）基金份额的转换

基金管理人将于选择期届满后对投资者未赎回的安信一带一路份额以及持有的安信一带一路A份额和安信一带一路B份额进行基金份额的转换，将安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的各类基金份额转换成安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的基金份额（具体以基金管理人届时公告为准）。

本次基金份额的转换主要可分为以下两个步骤进行：

1、将安信一带一路A份额与安信一带一路B份额转换成安信一带一路份额的场内份额

在份额转换基准日日终，安信一带一路A份额与安信一带一路B份额终止上市，并以安信一带一路份额的基金份额净值为基准，按照安信一带一路A份额与安信一带一路B份额各自的基金份额参考净值转换成安信一带一路份额的场内份额。基金份额转换比例保留至小数点后第8位，小数点第8位以后的部分四舍五入。安信一带一路A份额（或安信一带一路B份额）基金份额持有人持有的转换后安信一带一路份额的场内份额取整计算（最小单位为1份），取整后的余额计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的安信一带一路A份额、安信一带一路B份额，存在着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。

份额转换的计算公式如下：

安信一带一路A份额（或安信一带一路B份额）的转换比例＝份额转换基准日安信一带一路A份额（或安信一带一路B份额）的基金份额参考净值/份额转换基准日安信一带一路份额的基金份额净值

安信一带一路A份额（或安信一带一路B份额）持有人持有的转换后安信一带一路份额的场内份额数＝基金份额持有人持有的转换前安信一带一路A份额（或安信一带一路B份额）的份额数×安信一带一路A份额（或安信一带一路B份额）的转换比例

2、将安信一带一路份额转换成安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）份额

在安信一带一路A份额与安信一带一路B份额转换为安信一带一路份额的场内份额后，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将安信一带一路份额的场内份额和场外份额分别转换为份额净值为1.0000元的安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的场内和场外份额。

份额转换的计算公式如下：

安信一带一路份额的场内份额（或场外份额）的转换比例＝份额转换基准日安信一带一路份额的场内份额（或场外份额）基金份额净值/1.0000

转换后安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的场内份额（或场外份额）的份额数＝基金份额持有人持有的转换前安信一带一路份额的场内份额（或场外份额）的份额数×安信一带一路份额的场内份额（或场外份额）的转换比例

基金份额转换比例保留至小数点后第8位，小数点第8位以后的部分四舍五入。基金份额转换后，场外的安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后2位，场内的安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的份额数保留至整数位，由此产生的误差计入基金财产。

除保留位数因素影响外，基金份额的转换对基金份额持有人的权益无实质性不利影响。

（六）基金合同的生效

本基金份额持有人大会决议生效后，关于《安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效及《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》同时失效的时间安排，请详见基金管理人届时发布的相关公告。

安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同生效后，基金管理人将根据相关规定办理安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的申购赎回等业务。基金合同生效后，在符合法律法规规定的上市条件的情况下，基金管理人可以根据有关规定，申请安信中证一带一路主题指数证券投资基金（LOF）的基金份额上市交易。详见后续公告。

（七）修改基金的投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征

1、投资范围

原有表述为：

"本基金的投资范围为具有良好流动性的金融资产，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、资产支持证券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融资产（但须符合中国证监会相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于中证一带一路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80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。"

拟修改为：

"本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券、次级债）、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融资产（但须符合中国证监会相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。"

2、投资策略

原有表述为：

"2、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

3、债券投资策略

本基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

4、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价，在此基础上谨慎进行权证投资。本基金还可利用权证与标的股票之间可能存在形成的风险对冲机会，在充分论证和模型分析的基础上谨慎构建套利投资组合，获取相对稳定的投资收益。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

5、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。本基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。"

拟修改为：

"2、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

3、债券投资策略

本基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

（1）利率债投资策略

久期是反映组合利率敏感性的最重要指标。本基金将及时跟踪影响市场资金供给与需求的关键变量，分析并预测收益率曲线变化趋势，根据收益率曲线的变化情况制定相应的债券配置策略，在利率水平上升趋势中缩短久期、在利率水平下降趋势中拉长久期，从而在债券因市场利率水平变化导致的价格波动中获利。

（2）信用债投资策略

根据宏观经济的运行状况和周期阶段，基于行业运行的特征与一般性规律分析企业债券、公司债券等发行人所处行业的发展趋势、市场景气度、竞争格局，以及结合发行人自身财务状况、竞争优势和管理水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定合理的企业债券、公司债券的信用风险利差。

（3）可转换债券投资策略

本基金可转换债券的投资采取基本面分析和量化分析相结合的方法。本基金管理人行业研究员对可转债发行人的公司基本情况进行深入研究，对公司的盈利和成长能力进行充分论证。在对可转换债券的价值评估方面，由于可转换债券内含权利价值，本基金将利用期权定价模型等数量化方法对可转换债券的价值进行估算，选择价值低估的可转换债券进行投资。

（4）可交换债券投资策略

本基金重视对可交换债券对应股票的分析与研究，选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。在基本面分析的基础上，综合分析可交换债券的债性特征、股性特征等因素，结合各种定价模型和规范化估值工具，对于债券进行科学的价值分析和价值投资。

4、国债期货投资策略

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

5、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。本基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。"

3、投资限制

原有表述为：

"1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金的股票资产投资比例不低于基金资产净值的90%，其中投资于中证一带一路指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产净值的80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（8）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（9）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（10）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（11）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（12）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

（13）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

（14）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（15）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（16）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（17）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（18）基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（19）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（20）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%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（21）本基金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的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第（2）、（10）、（20）、（21）条外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。"

拟修改为：

"1、组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金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、应收申购款等；

（3）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（5）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（6）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（7）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（8）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（9）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（10）本基金参与股指期货或国债期货的，在任何交易日日终，持有的买入股指期货及国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（11）本基金参与股指期货交易：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

3）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

4）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（12）本基金参与国债期货交易：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

3）本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

4）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

（13）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（14）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%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（15）本基金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的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

（16）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（7）、（14）、（15）情形外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。"

4、风险收益特征

原有表述为：

"本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。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。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，安信一带一路A份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征；安信一带一路B份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。"

拟修改为：

"本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期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。"

（八）修改基金资产估值

1、估值对象

原有表述为：

"基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。"

拟修改为：

"基金所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。"

2、增加估值原则

"基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。"

3、估值方法

原有表述为：

"1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定。

6、股指期货合约，以估值日结算价估值；估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的结算价估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。"

拟修改为：

"1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（下转B38版）

安信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告

安信基金管理有限责任公司（以下简称"基金管理人"或"本公司"）决定以通讯方式召开安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称"本基金"；安信一带一路份额：场内简称"一带分级"，基金代码"167503"，包含场内份额和场外份额；安信一带一路A份额：场内简称"一带一A"，基金代码"150275"；安信一带一路B份额：场内简称"一带一B"，基金代码"150276"）的基金份额持有人大会，会议投票表决起止时间为自2020年10月16日起，至2020年10月28日17:00止。为保护投资者利益，现基金管理人提示如下：

一、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、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》的要求于2020年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将安信一带一路A份额与安信一带一路B份额按照基金份额参考净值转换为安信一带一路份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

二、一带一A与一带一B将于基金份额持有人大会计票日（2020年10月29日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止停牌。如基金份额持有人大会决议生效公告日为非交易日，则下一交易日开市复牌。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

三、本次基金份额持有人大会相关公告可通过基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话4008-088-088咨询或登录基金管理人网站（www.essencefund.com）获取相关信息。

安信基金管理有限责任公司
2020年9月28日