

# 安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金定期份额折算及折算期间暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管业务的公告

根据《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”），及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，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”）将于 2020 年 12 月 15 日办理定期份额折算业务。

相关事项公告如下：

## 一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日）

本次定期份额折算基准日为 2020 年 12 月 15 日。

## 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的安信一带一路 A 份额（场内简称“一带一 A”，基金代码：150275）、安信一带一路份额（场内简称“一带分级”，基金代码：167503）。

## 三、基金份额折算频率

每年折算一次。

## 四、基金份额折算方式

定期份额折算后安信一带一路 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前安信一带一路 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为安信一带一路份额的场内份额分配给安信一带一路 A 份额持有人。安信一带一路份额持有人持有的每两份安信一带一路份额将按一份安信一带一路 A 份额获得新增安信一带一路份额的分配，经过上述份额折算后，安信一带一路份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，安信一带一路 A 份额和安信一带一路 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

（一）有关计算公式如下：

### 1、安信一带一路份额

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前安信一带一路份额的资产净值} - 0.5 \times (\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.000) \times \text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}{\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

安信一带一路份额持有人新增的安信一带一路份额 =

$$\frac{\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$ ：折算后安信一带一路份额的基金份额净值，下同

$NAV_A^{\text{前}}$ ：折算前安信一带一路 A 份额的基金份额参考净值，下同

$\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}$ ：折算前安信一带一路份额的份额数，下同

持有场外安信一带一路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外安信一带一路份额的分配；持有场内安信一带一路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内安信一带一路份额的分配。

## 2、安信一带一路 A 份额

定期份额折算后安信一带一路 A 份额的基金份额参考净值 = 1.000 元

定期份额折算后安信一带一路 A 份额的份额数 = 定期份额折算前安信一带一路 A 份额的份额数

安信一带一路 A 份额持有人新增的场内安信一带一路份额的份额数 =

$$\frac{\text{NUM}_A^{\text{前}} \times (\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.000)}{\text{NAV}_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$\text{NUM}_A^{\text{前}}$ ：折算前安信一带一路 A 份额的份额数，下同

## 3、安信一带一路 B 份额

定期份额折算不改变安信一带一路 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

## 4、折算后的安信一带一路份额总份额数

折算后安信一带一路份额的总份额数 = 折算前安信一带一路份额的份额数 + 安信一带一路份额持有人新增的安信一带一路份额的份额数 + 安信一带一路 A 份额持有人新增的场内安信一带一路份额的份额数

## (二) 折算期间份额的处理方式

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；场内份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。如相关规则及有关规定有变化，以其最新规定为准。

### （三）举例

假设本基金定期份额折算基准日为 8 月 10 日，安信一带一路份额当天折算前资产净值为 8,659,000,000 元。当天场外安信一带一路份额、场内安信一带一路份额、安信一带一路 A 份额、安信一带一路 B 份额的份额数分别为 55 亿份、10 亿份、20 亿份、20 亿份。本次定期份额折算基准日安信一带一路份额 A 份额参考净值为 1.065 元，且未进行不定期份额折算。

定期份额折算的对象为基准日登记在册的安信一带一路 A 份额和安信一带一路份额，即 20 亿份和 65 亿份。

#### （1）安信一带一路份额持有人

定期份额折算后安信一带一路份额的份额净值：

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前安信一带一路份额的资产净值} - 0.5 \times (\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.000) \times \text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}{\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

$$= \frac{8659000000 - 0.5 \times (1.065 - 1) \times 6500000000}{6500000000} = 1.3 \text{ 元}$$

安信一带一路份额持有人新增的安信一带一路份额数=

$$\frac{\text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{基础}}^{\text{后}}} = \frac{0.5 \times (1.065 - 1) \times 6500000000}{1.3}$$

$$= 162500000 \text{ 份}$$

安信一带一路份额持有人在定期折算后持有的安信一带一路份额

$$= 6500000000 + 162500000 = 6662500000 \text{ 份}$$

安信一带一路份额持有人在定期折算后总共持有 6,662,500,000 份安信一带一路份额，基金份额净值为 1.300 元。

#### （2）安信一带一路份额 A 份额持有人

定期份额折算后安信一带一路 A 份额的份额数=定期份额折算前安信一带一路 A 份额的份额数=20 亿

$$\begin{aligned} \text{安信一带一路 A 份额持有人新增的安信一带一路份额} &= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}} \\ &= \frac{2000000000 \times (1.065 - 1)}{1.3} = 100000000 \text{ 份} \end{aligned}$$

安信一带一路 A 份额持有人在定期折算后总共持有 20 亿份安信一带一路 A 份额，基金份额净值为 1 元；新增持有 100,000,000 份安信一带一路份额，基金份额净值为 1.300 元。

#### （四）其他事项说明

在实施定期份额折算时，安信一带一路 A 份额及安信一带一路份额折算的具体计算过程及计算结果以基金管理人届时发布的折算结果公告为准。

#### 五、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即 2020 年 12 月 15 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、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；安信一带一路 A 份额和安信一带一路 B 份额正常交易。折算基准日日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例并进行份额折算。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 12 月 16 日），本基金将暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务；安信一带一路 A 份额暂停交易，安信一带一路 B 正常交易。登记结算机构及基金管理人将完成份额登记确认。

3、定期份额折算日后的第二个工作日（即 2020 年 12 月 17 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，安信一带一路 A 份额和安信一带一路 B 份额正常交易。自该日起，本基金恢复办理申购（自 2019 年 7 月 26 日起暂停的场内申购业务将继续暂停）、赎回、转换（自 2019 年 7 月 26 日起暂停的场内转换转入业务将继续暂停）、定期定额投资（自 2019 年 7 月 26 日起暂停的场内定期定额投资业务将继续暂停）、转托管（自 2019 年 7 月 26 日起暂停的跨系统转托管(场外转场内)业务将继续暂停)、配对转换业务。

4、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》，2020 年 12 月 17 日安信一带一路 A 份额即时行情显示的前收盘价为 2020 年 12 月 16 日

的安信一带一路 A 份额基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。

5、2020 年 12 月 17 日安信一带一路 A 份额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、本基金安信一带一路 A 份额将于 2020 年 12 月 16 日停牌一天。

2、由于安信一带一路 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，定期份额折算后，安信一带一路 A 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折溢价所带来的风险。

3、安信一带一路 A 份额的约定应得收益将折算成安信一带一路场内份额分配给安信一带一路 A 份额的持有人，而安信一带一路份额为跟踪中证一带一路主题指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此安信一带一路 A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

4、安信一带一路 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安信一带一路份额分拆为安信一带一路 A 份额和安信一带一路 B 份额。

5、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，持有极小数量安信一带一路场内份额、安信一带一路 A 份额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。

6、根据本基金管理人于 2019 年 2 月 27 日发布的《关于暂停安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告》、2019 年 7 月 25 日发布的《关于安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金恢复场外大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务并暂停跨系统转托管（场外转场内）、场内申购业务的公告》，本基金自 2019 年 2 月 27 日起暂停单日单个账户累计 1000 元以上的大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务，并自 2019 年 7 月 26 日起恢复场外单日单个账户累计 1000 元以上的大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务，自 2019 年 7 月 26 日起暂停场内申购业务，自 2019 年 7 月 26 日起暂停基金份额的跨系统转托管（场外转场内）业务。自 2020 年 12 月 17 日起，本基金的场外申购、定期定额投资、场内

/场外赎回等业务照常办理。详见相关公告。

7、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“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。敬请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等相关法律文件。

特此公告。

安信基金管理有限责任公司

2020年12月10日