

# 安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2020年8月12日

送出日期：2020年8月25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	一带一 A	基金代码	150275	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	基金托管人	招商证券股份有限公司	
基金合同生效日	2015年5月14日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所	2015年5月22日
基金类型	股票型	交易币种	人民币	
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日	
基金经理	施荣盛	开始担任本基金基金经理的日期	2020年1月13日	
		证券从业日期	2013年7月2日	

## 二、基金投资与净值表现

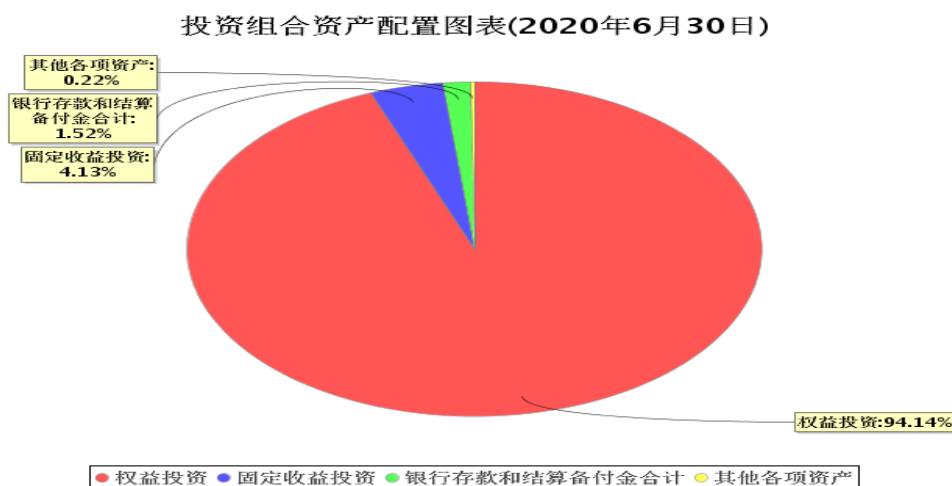
### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证一带一路主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资范围	<p>本基金的标的指数是中证一带一路主题指数。</p> <p>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）。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主要投资策略	股票投资上，本基金主要采用完全复制的方法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资；债券投资

	上，本基金将以宏观形势及利率分析为基础，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价；权证投资上，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，谨慎进行权证投资；资产支持证券投资方面，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。
<b>业绩比较基准</b>	中证一带一路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
<b>风险收益特征</b>	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。产品风险等级以各销售机构的评级结果为准。

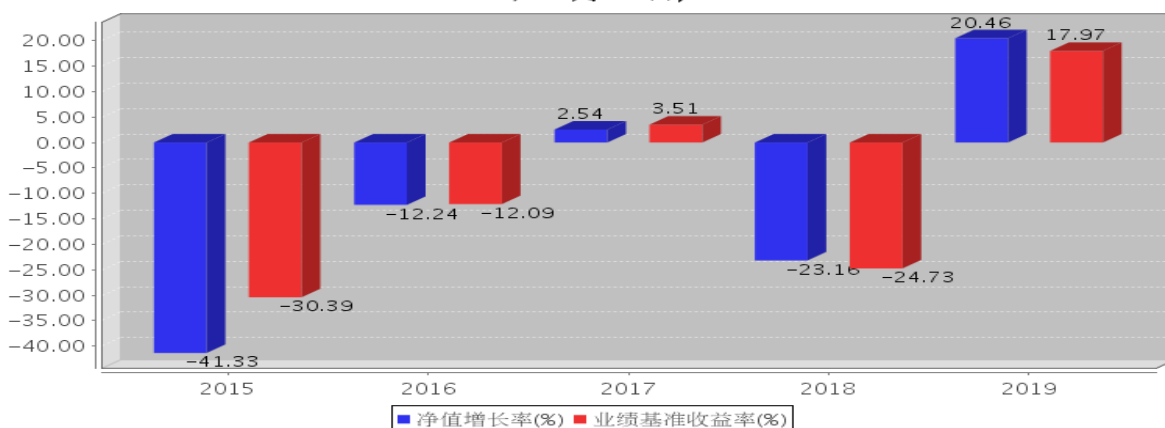
注: 详见《安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》第十三部分“基金的投资”。

### (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



### (三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

安信一带一路分级基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2019年12月31日)



注：基金的过往业绩并不代表其未来表现。

## 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：

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率	备注
认购费	$0 \leq M$	0.00%	本基金A类份额无认购费
申购费 (前收费)	$0 \leq M$	0.00%	本基金A类份额无申购费
赎回费	$N \geq 0$ 天	0.00%	本基金A类份额无赎回费

注:本基金A类基金份额不收取认/申购费与赎回费。

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%
其他费用	标的指数许可使用费、会计师费、律师费、信息披露费等

注: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。

## 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。

一) 本基金投资运作过程中面临的主要风险有:

1、市场风险; 2、信用风险; 3、债券收益率曲线变动风险; 4、再投资风险; 5、流动性风险; 6、管理风险; 7、操作或技术风险; 8、合规性风险; 9、基金估值风险; 10、本基金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

二) 本基金的特定风险

1、指数投资风险

(1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险; (2) 标的指数波动的风险; (3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险; (4) 标的指数变更的风险;

2、基金运作的特定风险

(1) 上市交易风险: 本基金在深圳证券交易所挂牌上市, 由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌, 投资人在停牌期间不能买卖本基金上市交易份额, 产生风险; 同时, 可能因上市后交易对手不足而产生流动性风险; 另外, 当基金份额持有人将份额转向场外交易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) 杠杆机制风险: 由于安信一带一路B份额内含杠杆机制的设计, 安信一带一路B份额的参考净值的变动幅度将大于安信一带一路份额的净值和安信一带一路A份额的参考净值的变动幅度, 即安信一带一路B份额的净值变动的波动性要高于其他两类份额。

(3) 折/溢价交易风险: 安信一带一路A份额和安信一带一路B份额上市交易后, 由于受市场供求关系的影响, 基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能发生偏离而出现折/溢价交易风险。

(4) 风险收益特征变化风险: 在实施基金份额折算后, 安信一带一路A份额持有人或安信一带一路B份额持有人将会获得一定比例的安信一带一路份额的场内份额, 因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

(5) 份额折算风险: ①在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。②份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

(6) 份额配对转换业务中存在的风险：一方面，份额配对转换业务的办理可能改变安信一带一路 A 份额和安信一带一路 B 份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

(7) 基金的收益分配：在存续期内，本基金将不进行收益分配（除未来法律法规或监管机构允许的情况外）。本基金管理人将根据基金合同的约定对本基金实施份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过卖出或赎回折算后的新增份额的方式获取投资回报，但是，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。

## (二) 重要提示

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”）于 2015 年 4 月 29 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]770 号文准予募集。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。

除监管规定信息发生重大变更外，基金管理人每年更新一次资料概要。因此，本文件内容可能存在一定的滞后性，敬请投资者同时关注基金管理人发布的临时公告。

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，则任何一方有权将争议提交位于北京市的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见安信基金官方网站 [www.essencefund.com] [客服电话：4008-088-088]

- 1、《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》
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料