

# 安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资 基金 2018 年第 3 季度报告

2018 年 09 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 安信复兴 100 指数   |
| 交易代码       | 005807  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2018 年 06 月 21 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 129,145,763.85 份  |
| 投资目标       | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证复兴发展 100 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。   |
| 投资策略       | 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。<br>在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股 |

|                 |   |                |
|-----------------|---|----------------|
|                 | 停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。           |                |
| 业绩比较基准          | 中证复兴发展 100 主题指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%  |                |
| 风险收益特征          | 本基金为股票型，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金债券型基金和货币市场基金。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。 |                |
| 基金管理人           | 安信基金管理有限责任公司  |                |
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司  |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 安信复兴 100 指数 A   | 安信复兴 100 指数 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 005807  | 005808         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 127,066,185.57 份  | 2,079,578.28 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2018 年 07 月 01 日 - 2018 年 09 月 30 日) |               |
|-----------------|--|---------------|
|                 | 安信复兴 100 指数 A                            | 安信复兴 100 指数 C |
| 1. 本期已实现收益      | -3,330,881.22                            | -62,938.34    |
| 2. 本期利润         | -3,191,146.52                            | -657,500.40   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0202                                  | -0.0403       |
| 4. 期末基金资产净值     | 124,302,612.70                           | 2,031,890.21  |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9783                                   | 0.9771        |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除

相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信复兴 100 指数 A

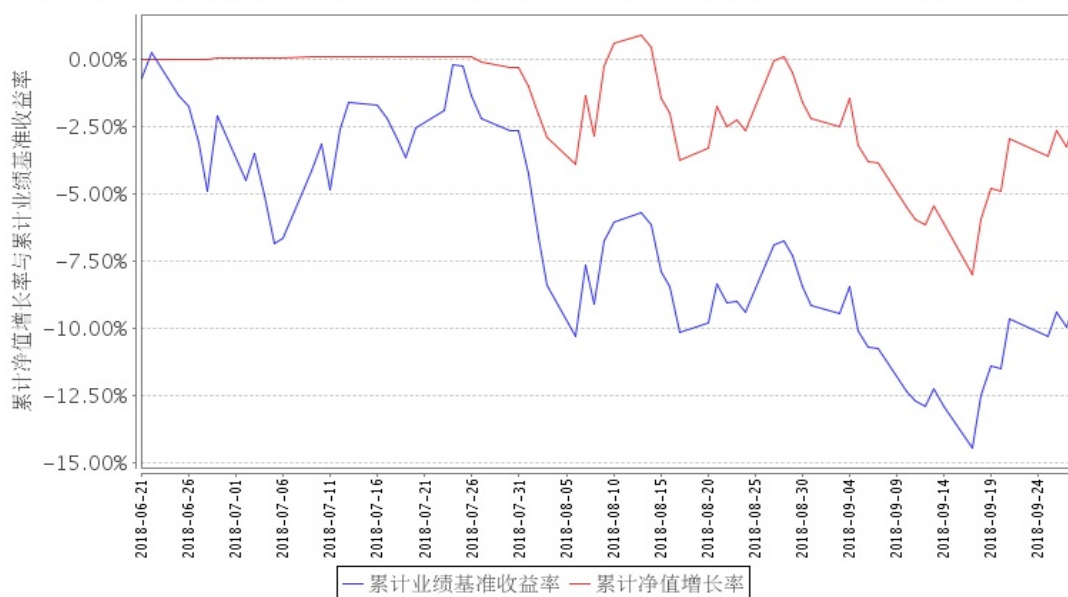
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -2.22% | 1.03%     | -7.01%     | 1.38%         | 4.79% | -0.35% |

安信复兴 100 指数 C

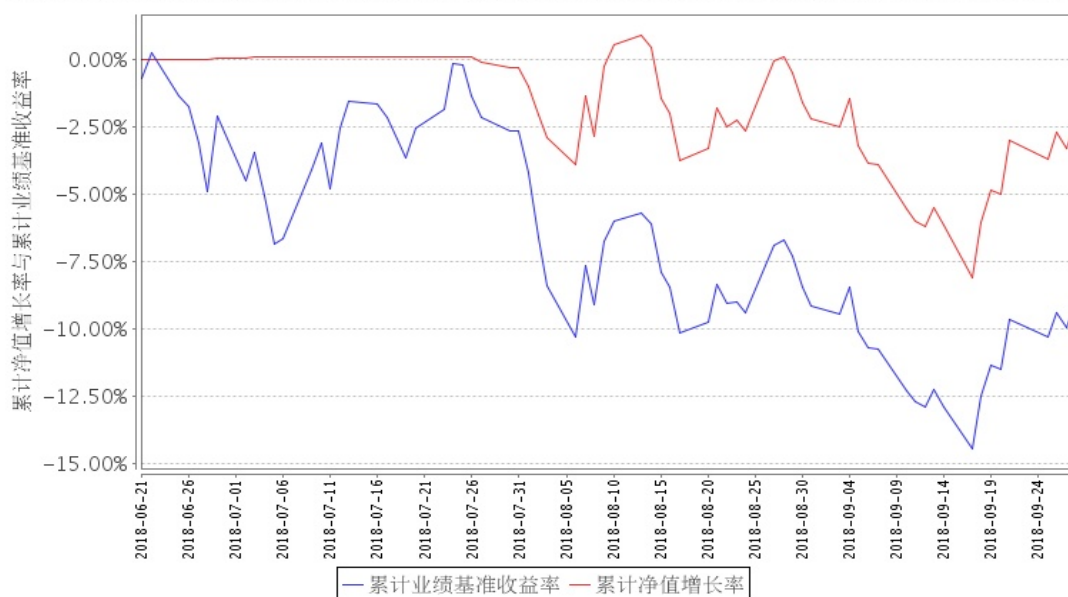
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -2.34% | 1.03%     | -7.01%     | 1.38%         | 4.67% | -0.35% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信复兴100指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信复兴100指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2018 年 6 月 21 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明            |
|----|------|-------------|------|--------|---------------|
|    |      | 任职日期        | 离任日期 |        |               |
| 龙川 | 本基金的 | 2018 年      | -    | 16 年   | 龙川先生，统计学博士。历任 |

|  |                       |          |  |  |   |
|--|-----------------------|----------|--|--|---|
|  | 基金经理，<br>量化投资<br>部总经理 | 6 月 21 日 |  |  | Susquehanna International Group (美国) 量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。现任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、安信基金稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金、安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金、安信量化优选股票型发起式证券投资基金的基金经理。 |
|--|-----------------------|----------|--|--|---|

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场回顾：今年三季度市场延续上半年的下跌走势，上证指数下跌 0.92%，沪深 300 指数下

跌 2.05%，中证 500 指数下跌 7.99%，创业板指数下跌 12.16%，今年以来沪深 300 指数下跌 14.69%，中证 500 指数下跌 23.2%。我们对未来市场相对比较谨慎，主要原因在于不确定性显著加强：首先全球贸易角度看，贸易保护主义抬头，贸易摩擦加剧加之地缘政治问题凸显，不仅是中美贸易摩擦有不断加剧的趋势，其长期的不确定性对全球经济可能会产生较大冲击；其次是国内不确定性也在增加，在金融去杠杆的政策背景下，信贷资金难以与信托等非标资金衔接，部分实体融资难的问题难以解决。国内无风险利率即使出现一定的下行，也难以达到普惠的作用。未来不确定性远超过往，预期收益率大概率显著低于过往几年。市场也存在一些积极的因素：

（1）减税预期增强，这对于促进消费，降低企业成本起到重要推力；（2）贸易战具有长期性，但对市场冲击最严重的时间窗口可能已经过去；（3）信用风险和质押爆仓的风险在边际好转，中小企业的融资环境正在改善；（4）整体估值处于历史低位，产业资本回购、增持等积极信号在增加。

投资策略：目前本基金仍处于建仓期，报告期内仓位逐渐增加。今后本基金将秉承指数基金的投资策略，在应对申购赎回的基础上，跟踪指数收益，力争将基金跟踪误差控制在合理范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类基金份额净值为 0.9783 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.22%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 0.9771 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.34%；同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目         | 金额（人民币元）       | 占基金总资产的比例（%） |
|----|------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资       | 117,633,208.86 | 92.58        |
|    | 其中：股票      | 117,633,208.86 | 92.58        |
| 2  | 基金投资       | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资     | -              | -            |
|    | 其中：债券      | -              | -            |
|    | 资产支持<br>证券 | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资      | -              | -            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 9,173,150.85   | 7.22   |
| 8 | 其他资产              | 259,420.32     | 0.20   |
| 9 | 合计                | 127,065,780.03 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | 4,314,536.00   | 3.42         |
| C  | 制造业              | 79,301,959.33  | 62.77        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 440,863.00     | 0.35         |
| E  | 建筑业              | 6,069,812.00   | 4.80         |
| F  | 批发和零售业           | 6,770,846.03   | 5.36         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,105,885.00   | 2.46         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,373,744.00   | 1.88         |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | 10,014,572.76  | 7.93         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,580,528.74   | 1.25         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 143,408.00     | 0.11         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 674,240.00     | 0.53         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 1,460,064.00   | 1.16         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 1,382,750.00   | 1.09         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 117,633,208.86 | 93.11        |



### 报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600104 | 上汽集团 | 193,800 | 6,449,664.00 | 5.11         |
| 2  | 000002 | 万科A  | 247,740 | 6,020,082.00 | 4.77         |
| 3  | 601012 | 隆基股份 | 347,100 | 4,928,820.00 | 3.90         |
| 4  | 600028 | 中国石化 | 579,900 | 4,128,888.00 | 3.27         |
| 5  | 600585 | 海螺水泥 | 110,300 | 4,057,937.00 | 3.21         |
| 6  | 600309 | 万华化学 | 90,666  | 3,850,585.02 | 3.05         |
| 7  | 600332 | 白云山  | 100,100 | 3,663,660.00 | 2.90         |
| 8  | 601186 | 中国铁建 | 253,200 | 2,823,180.00 | 2.23         |
| 9  | 600482 | 中国动力 | 120,100 | 2,782,717.00 | 2.20         |
| 10 | 601006 | 大秦铁路 | 328,800 | 2,706,024.00 | 2.14         |

### 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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，以套期保值为目的，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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除白云山（股票代码：600332）、中国动力（股票代码：600482），本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

广州白云山医药集团股份有限公司白云山何公制药厂于 2017 年 12 月 26 日收到由广州市食品药品监督管理局发出的食品药品行政执法文书《行政处罚决定书》（穗）食药监药罚

【2017】155 号（“处罚决定书”），明确何济公药厂于 2016 年 12 月至 2017 年 2 月期间生产药品曲咪新乳膏（批号：A1089），经菏泽市食品药品检验检测研究院检验“装量”检验项的检验结果不符合规定，予以以下处罚：1、没收本批次产品销售所得 166,565.21 元；2、罚款 183,221.73 元。

中国船舶重工集团动力股份有限公司（下称中国动力）因未按要求及时披露 2016 年年度业绩预告、未按要求及时披露大额政府补助信息等行为，违反了《上海证券交易所股票上市规则》，于 2018 年 1 月 18 日受到上海证券交易所如下纪律处分决定：对中国船舶重工集团动力股份有限公司和时任财务总监韩军、时任董事会秘书王彬予以通报批评。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（人民币元）   |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 37,513.90  |
| 2  | 应收证券清算款 | 215,619.46 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 2,031.32   |
| 5  | 应收申购款   | 4,255.64   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 259,420.32 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 安信复兴 100 指数 A  | 安信复兴 100 指数 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 297,585,490.89 | 35,097,805.58 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 620,757.13     | 288,360.53    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 171,140,062.45 | 33,306,587.83 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -             |

|             |                |              |
|-------------|----------------|--------------|
| 报告期期末基金份额总额 | 127,066,185.57 | 2,079,578.28 |
|-------------|----------------|--------------|

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末本基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2018 年 10 月 25 日