安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金2018年年度报告摘要

2018年12月31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

送出日期：2019年03月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2019年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2018年6月21日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	安信复兴 100 指数	
基金主代码	005807	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 21 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	
报告期末基金份额总额	122,417,656.52 份	
基金合同存续期	不定期	
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	120,356,453.14 份	2,061,203.38 份

2.2 基金产品说明

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。 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	贺倩
	联系电话	0755-82509999	010-66060069
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95599
传真		0755-82799292	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年06月21日（基金合同生效日）-2018年12月31日	
	安信复兴100指数A	安信复兴100指数C
本期已实现收益	-4,640,465.88	-72,344.20
本期利润	-16,413,587.05	-861,676.82
加权平均基金份额本期利润	-0.1046	-0.0787
本期基金份额净值增长率	-12.94%	-13.10%
3.1.2 期末数	2018年末	

据和指标		
期末可供分配基金份额利润	-0.1294	-0.1310
期末基金资产净值	104,783,634.51	1,791,208.99
期末基金份额净值	0.8706	0.8690

注:1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-11.01%	1.63%	-10.84%	1.65%	-0.17%	-0.02%
过去六个月	-12.98%	1.35%	-17.08%	1.51%	4.10%	-0.16%
自基金合同	-12.94%	1.31%	-18.82%	1.51%	5.88%	-0.20%

安信复兴100指数C

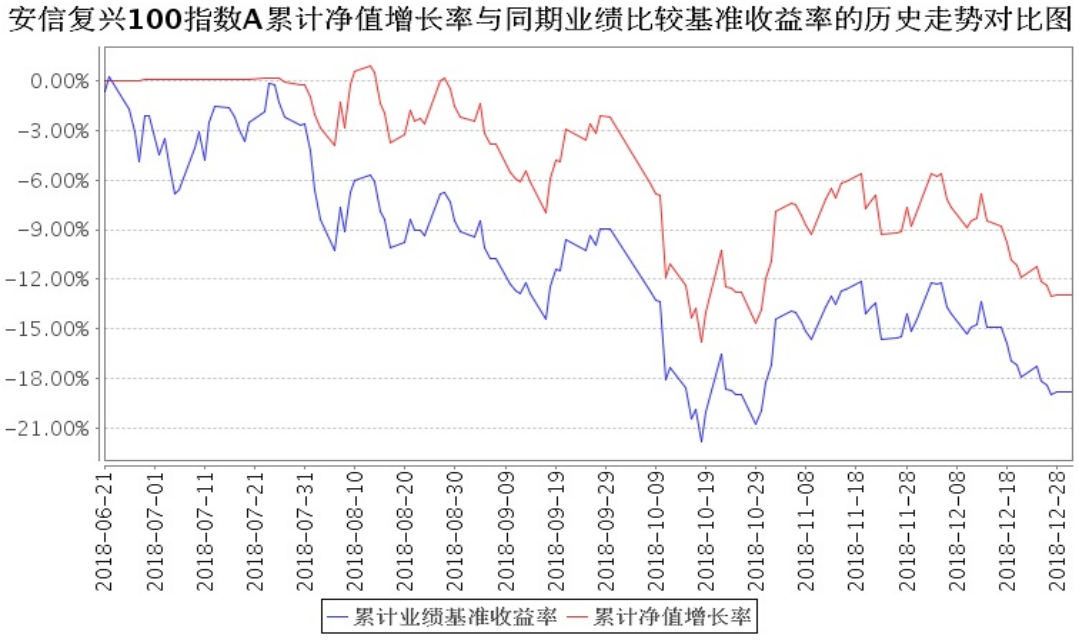
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-11.06%	1.63%	-10.84%	1.65%	-0.22%	-0.02%
过去六个月	-13.14%	1.35%	-17.08%	1.51%	3.94%	-0.16%
自基金合同	-13.10%	1.31%	-18.82%	1.51%	5.72%	-0.20%

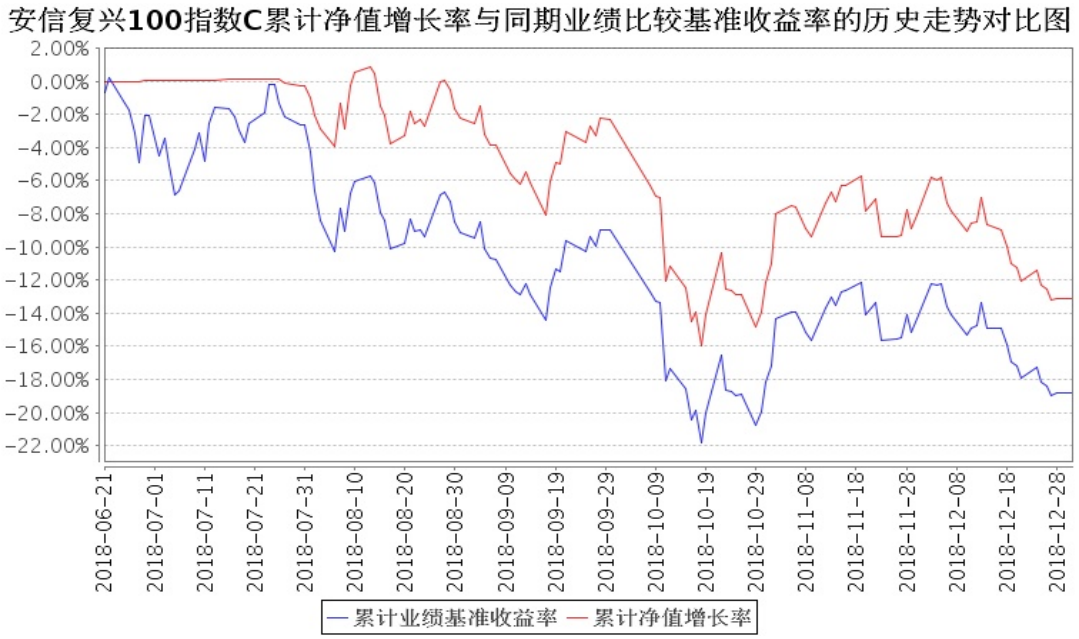
注:根据《安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中证复兴发展100主题指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。由于本基金投资

标的指数为中证复兴发展 100 主题指数，且每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为中证复兴发展 100 主题指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率（税后）×5%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

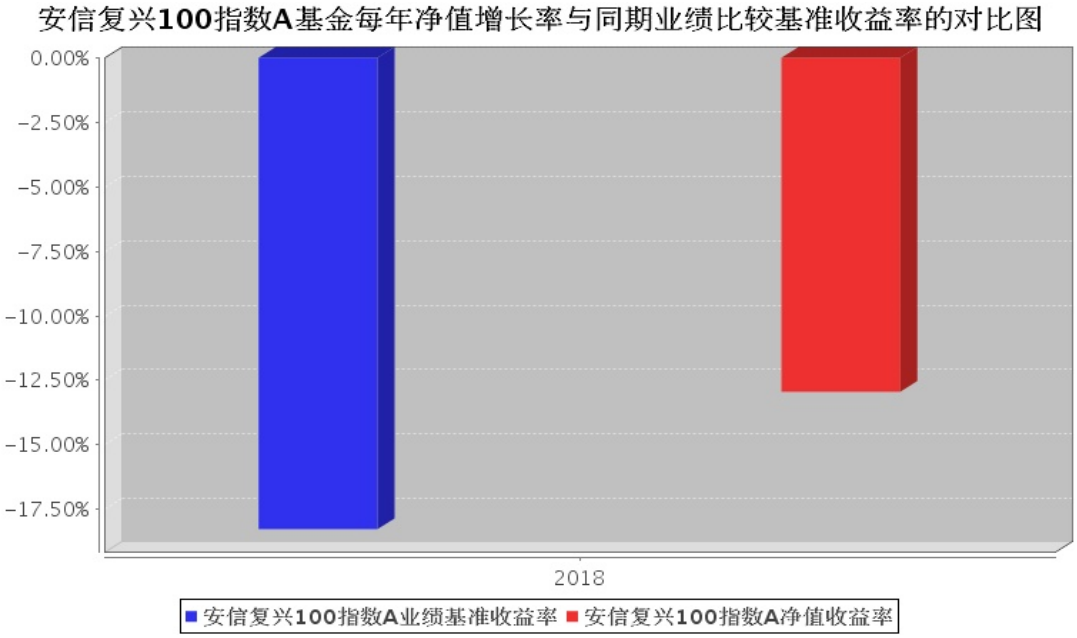


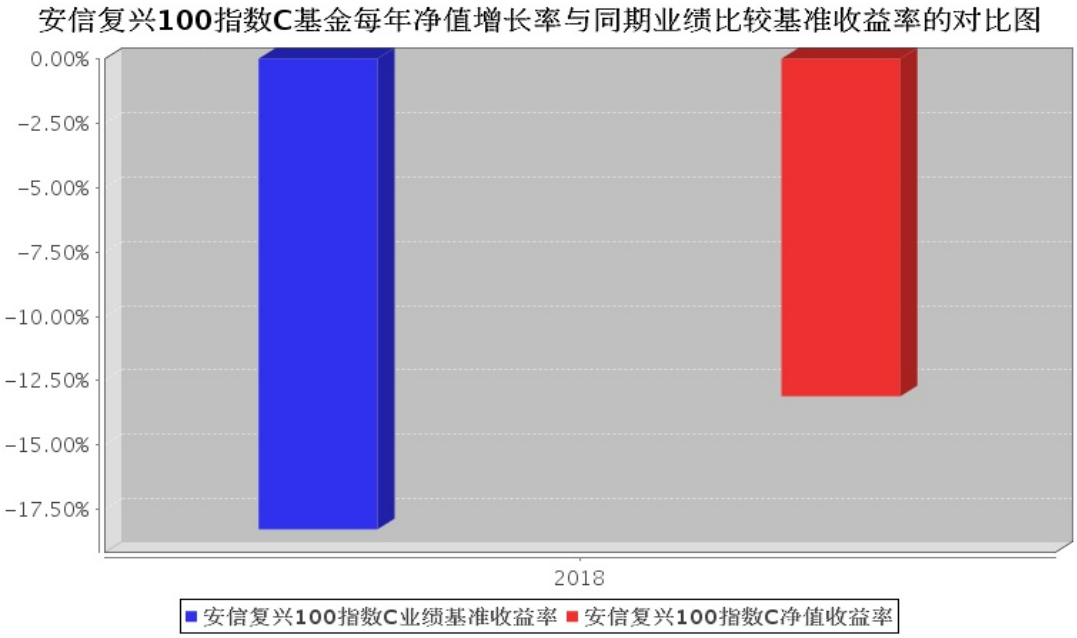


注:1、本基金基金合同生效日为 2018 年 6 月 21 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2018 年 6 月 21 日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于2011年12月，总部位于深圳，注册资本5.0625亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有39.84%的股权，安信证券股份有限公司持有33.95%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有20.28%的股权，中广核财务有限责任公司持有5.93%的股权。

截至2018年12月31日，本基金管理人共管理45只开放式基金，具体如下：从2012年6月20日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金；从2012年9月25日起管理安信目标收益债券型证券投资基金；从2012年12月18日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金；从2013年2月5日起管理安信现金管理货币市场基金；从2013年7月24日起管理安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）；从2013年11月8日起管理安信永利信用定期开放债券型证券投资基金；从2013年12月31日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金；从2014年4月21日起管理安信价值精选股票型证券投资基金；从2014年11月24日起管理安信现金增利货币市场基金；从2015年3月19日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金；从2015年4月15日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金；从2015年5月14日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金；从2015年5月20日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金；从2015年5月25日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金；从2015年6月5日起管理安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金；从2015年8月7日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金；从2015年11月24日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金；从2016年3月9日至2018年5月28日管理安信安盈保本混合型证券投资基金；从2016年5月9日起管理安信新回报灵活配置混合型证券投资基金；从2016年7月28日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金；从2016年8月9日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金；从2016年8月19日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金；从2016年9月9日至2018年9月26日管理安信保证金交易型货币市场基金；从2016年9月29日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金；从2016年9月29日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金；从2016年10月10日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金；从2016年10月12日起管理安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金；从2016年10月17日起管理安信活期宝货币市场基金；从2016年12月9日起管理安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金；从2016年12月19日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金；从

2017年1月13日至2018年6月11日管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金；从2017年3月16日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金；从2017年3月16日起管理安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从2017年3月29日起管理安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从2017年7月3日起管理安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金；从2017年7月20日起管理安信工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金；从2017年12月6日起管理安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金；从2017年12月28日起管理安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金；从2018年3月14日起管理安信尊享添益债券型证券投资基金；从2018年3月21日起管理安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金；从2018年3月30日起管理安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金；从2018年6月1日起管理安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金；从2018年6月12日起管理安信永鑫增强债券型证券投资基金；从2018年6月21日起管理安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金；从2018年9月3日起管理安信量化优选股票型发起式证券投资基金；从2018年9月26日起管理安信恒利增强债券型证券投资基金；从2018年11月29日起管理安信中证500指数增强型证券投资基金；从2018年12月7日起管理安信优享纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙川	本基金的基金经理，量化投资部总经理	2018年6月21日	-	16	龙川先生，统计学博士。历任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、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、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。
杨扬	本基金的基金经理助	2018年11月14日	-	7	杨扬先生，清华大学工学硕士。历任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究助理，上海东方证券资产管理有限

	理				公司量化投资部研究员、投资助理，安信基金管理有限责任公司量化投资部投资经理助理、投资经理、基金经理助理。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任安信中证一带一路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、安信中证复兴发展 100 主题指数证券投资基金的基金经理助理；现任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、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

4.3.2 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，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场回顾：2018 年全年股票市场基本呈现单边下跌态势，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证500指数下跌33.32%，全部A股上市公司的跌幅中位数超过30%。分行业来看，2018年休闲服务、银行、食品饮料等行业跌幅较少，电子、传媒、有色等行业跌幅较大。上半年，市场预期发生较大变化，房地产新开工面积增速大幅下降、资金来源情况变差，叠加销售增速持续下滑，市场对2018年房地产投资增速预期变得相对谨慎；中美贸易战骤然来袭，使出口面临失速风险；制造业投资回暖，不抵地产投资和基建投资向下压力；消费端，必选消费增长放缓叠加举债透支影响逐步显现，消费对经济支撑作用弱化。下半年，国常会政策取向开始扭转，但海外市场的回落，加上国内股票价格下跌与质押盘违约的螺旋再次显现，投资者情绪极低，A 股调整幅度较大。考虑到内外经济下行趋势基本形成，国内政策托底传导至实体信用环境还未改观，企业盈利能力还可能受到需求和成本冲击，盈利增速下滑，A股震荡下行。

投资策略：本基金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 基金份额净值为 0.8706 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.94%；截至本报告期末本基金C基金份额净值为0.8690元，本报告期基金份额净值增长率为-13.10%；同期业绩比较基准收益率为-18.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为市场指数的大幅下跌，体现出当前市场情绪十分低迷，从2018年各项经济数据来看，尤其是发电量、工业增加值、汽车销量、商品房销售面积等数据表明整个经济放缓趋势比较明显，我们认为2019年上半年宏观经济依然存在继续走弱的可能。但与此同时，国家层面各种稳增长的政策也在陆续出台，包括减税降费，降准等利好政策，从近期央行的表态来看货币政策也在转向适当宽松，我们认为对中国经济的长期前景不必过分担忧，市场层面来看，无论是从各大指数的估值角度，还是上市公司破净股的个数等方面，都可以看出市场指数已经处于历史低估的状态，与历史上几次底部区域的估值已经十分接近。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的副总经理担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、信用研究部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—安信基金管理有限责任公司2018年1月1日至2018年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，安信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容，应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日
资 产：	
银行存款	7,567,560.69
结算备付金	6,955.92
存出保证金	59,070.38
交易性金融资产	99,366,885.23
其中：股票投资	99,366,885.23
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-

应收证券清算款	253,516.92
应收利息	1,710.38
应收股利	-
应收申购款	3,182.60
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	107,258,882.12
负债和所有者权益	**本期末 2018年12月31日**
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	296,037.27
应付赎回款	91,358.44
应付管理人报酬	47,399.39
应付托管费	9,479.85
应付销售服务费	396.35
应付交易费用	49,367.10
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	190,000.22
负债合计	684,038.62
所有者权益：	
实收基金	122,417,656.52
未分配利润	-15,842,813.02
所有者权益合计	106,574,843.50
负债和所有者权益总计	107,258,882.12

注:1、报告期截止日2018年12月31日，本基金A类基金份额净值0.8706元，本基金C类基金份额净值0.8690元，本基金份额总额122,417,656.52份，其中A类基金份额120,356,453.14份，C类基金份额2,061,203.38份。

2、本基金的基金合同于2018年6月21日生效，无上年度可比期间。

7.2 利润表

会计主体：安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金

本报告期：2018年6月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期

	2018年6月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
一、收入	-16,126,351.78
1.利息收入	483,142.02
其中：存款利息收入	251,216.91
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	231,925.11
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-4,238,114.19
其中：股票投资收益	-4,823,087.31
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	584,973.12
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-12,562,453.79
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	191,074.18
减：二、费用	1,148,912.09
1．管理人报酬	414,412.08
2．托管费	82,882.37
3．销售服务费	13,497.54
4．交易费用	334,376.97
5．利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6．税金及附加	-
7．其他费用	303,743.13
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-17,275,263.87
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-17,275,263.87

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金

本报告期：2018年6月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者	458,401,829.60	-	458,401,829.60

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-17,275,263.87	-17,275,263.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-335,984,173.08	1,432,450.85	-334,551,722.23
其中：1.基金申购款	1,385,679.74	-51,443.58	1,334,236.16
2.基金赎回款	-337,369,852.82	1,483,894.43	-335,885,958.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	122,417,656.52	-15,842,813.02	106,574,843.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

刘入领	范瑛	苗杨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于2018年2月2日下发的证监许可[2018]247号文“关于准予安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金于二零一八年五月七日首次发售，二零一八年六月十五日募集结束，发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资

人。募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2018)验字第60962175_H10号验资报告。经向中国证监会备案，《安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金基金合同》于二零一八年六月二十一日正式生效。根据《安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金基金合同》及《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》的规定，安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金的有效认购款项在基金募集期间产生的利息折算成基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。截至二零一八年六月二十日止，安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 458,147,902.60 元，折合458,147,902.60 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币 253,927.00元，折合253,927.00份基金份额。其中A类基金份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币423,039,810.68元，折合423,039,810.68份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币244,089.25元，折合244,089.25份基金份额。C类基金份额已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 35,108,091.92 元，折合35,108,091.92份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币9,837.75元，折合 9,837.75 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 458,401,829.60 元，折合458,401,829.60份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证复兴发展100主题指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、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他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；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，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

本基金的业绩比较基准为：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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2018年12月31日的财务状况以及2018年6月21日（基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日至12月31日止。惟本会计期间为自2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，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，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述估值原则仍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，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再

投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

7.4.6.2 企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方

法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（以下简称“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
安信证券	2,797.00	0.00

7.4.9.1.2 权证交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
安信证券	1.99	0.00	-	-

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	414,412.08
其中：支付销售机构的客户维护费	230,377.96

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期

	2018 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	82,882.37

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信复兴 100 指数 A	安信复兴 100 指数 C	合计
农业银行	-	1,695.39	1,695.39
安信直销	-	5,945.83	5,945.83
安信证券	-	-	-
合计	-	7,641.22	7,641.22

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方本期末未持有本基金份额。

7.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	7,567,560.69	239,689.01

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

7.4.10 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 受限证券类别：权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.11.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.11.2 其他事项

(1)公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级余额为人民币99,316,739.43元，划分为第二层级的余额为人民币50,145.80，无划分为第三层级余额。

公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，

确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.11.3 财务报表的批准

本财务报表已于2019年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	99,366,885.23	92.64
	其中：股票	99,366,885.23	92.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	7,574,516.61	7.06
8	其他各项资产	317,480.28	0.30
9	合计	107,258,882.12	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	3,083,304.00	2.89
C	制造业	45,337,800.59	42.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	103,777.00	0.10
E	建筑业	5,385,549.00	5.05

F	批发和零售业	5,458,184.06	5.12
G	交通运输、仓储和邮政业	2,310,161.00	2.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,137,262.00	2.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,568,550.70	8.04
L	租赁和商务服务业	1,454,082.23	1.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	680,724.00	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,784,371.00	1.67
S	综合	-	-
	合计	76,303,765.58	71.60

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	3,446,463.00	3.23
C	制造业	11,267,652.85	10.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,820,736.00	1.71
F	批发和零售业	772,900.00	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	298,900.00	0.28
H	住宿和餐饮业	347,928.00	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,667,665.00	2.50
J	金融业	50,145.80	0.05
K	房地产业	1,184,078.00	1.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术	-	-

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	456,851.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	749,800.00	0.70
S	综合	-	-
	合计	23,063,119.65	21.64

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末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

金额单位：人民币元

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	000002	万　　科A	211,240	5,031,736.80	4.72
2	600104	上汽集团	165,100	4,403,217.00	4.13
3	600028	中国石化	579,900	2,928,495.00	2.75
4	601390	中国中铁	352,600	2,464,674.00	2.31
5	601186	中国铁建	217,600	2,365,312.00	2.22
6	601006	大秦铁路	280,700	2,310,161.00	2.17
7	002001	新　和　成	153,003	2,296,575.03	2.15
8	600309	万华化学	77,466	2,168,273.34	2.03
9	600031	三一重工	257,604	2,148,417.36	2.02
10	600482	中国动力	87,300	1,944,171.00	1.82

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于安信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

8.3.2 期末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

金额单位：人民币元

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	600332	白云山	100,100	3,579,576.00	3.36
2	600585	海螺水泥	94,400	2,764,032.00	2.59

3	601857	中国石油	380,700	2,744,847.00	2.58
4	603858	步长制药	86,280	2,181,158.40	2.05
5	600718	东软集团	169,100	1,953,105.00	1.83

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于安信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600104	上汽集团	6,806,238.00	6.39
2	000002	万　　科A	6,633,368.66	6.22
3	600309	万华化学	5,401,960.06	5.07
4	603858	步长制药	5,056,571.40	4.74
5	600585	海螺水泥	4,961,685.00	4.66
6	601012	隆基股份	4,300,849.00	4.04
7	600028	中国石化	3,883,906.00	3.64
8	600572	康恩贝	3,863,491.69	3.63
9	002179	中航光电	3,746,612.00	3.52
10	600760	中航沈飞	3,559,603.00	3.34
11	601006	大秦铁路	3,463,593.00	3.25
12	600332	白云山	3,268,690.00	3.07
13	600031	三一重工	3,064,262.80	2.88
14	601390	中国中铁	3,027,506.84	2.84
15	002001	新　和　成	2,954,096.48	2.77
16	601857	中国石油	2,925,121.00	2.74
17	002589	瑞康医药	2,867,080.10	2.69
18	001979	招商蛇口	2,743,444.93	2.57
19	600525	长园集团	2,701,197.00	2.53
20	600482	中国动力	2,700,044.00	2.53
21	000338	潍柴动力	2,681,519.00	2.52
22	601186	中国铁建	2,642,663.00	2.48
23	000581	威孚高科	2,551,176.99	2.39
24	000513	丽珠集团	2,525,023.05	2.37
25	600079	人福医药	2,415,295.00	2.27
26	002368	太极股份	2,394,791.00	2.25
27	000999	华润三九	2,297,704.00	2.16
28	600741	华域汽车	2,294,820.30	2.15
29	000063	中兴通讯	2,286,922.00	2.15
30	600056	中国医药	2,172,126.00	2.04
31	600438	通威股份	2,152,675.00	2.02

32	002310	东方园林	2,138,985.75	2.01

注:本项的"累计买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601012	隆基股份	6,327,359.20	5.94
2	600438	通威股份	2,996,099.00	2.81
3	000063	中兴通讯	2,908,313.00	2.73
4	603858	步长制药	2,484,278.20	2.33
5	000581	威孚高科	2,297,638.82	2.16
6	600079	人福医药	2,073,707.00	1.95
7	000002	万　　科A	2,061,743.00	1.93
8	300274	阳光电源	1,896,593.00	1.78
9	600572	康恩贝	1,837,512.00	1.72
10	002179	中航光电	1,822,837.00	1.71
11	002368	太极股份	1,784,586.00	1.67
12	000513	丽珠集团	1,743,768.60	1.64
13	600760	中航沈飞	1,665,461.00	1.56
14	600104	上汽集团	1,593,394.00	1.50
15	002019	亿帆医药	1,511,002.48	1.42
16	600029	南方航空	1,470,966.00	1.38
17	600380	健康元	1,468,131.28	1.38
18	300355	蒙草生态	1,384,609.60	1.30
19	000516	国际医学	1,347,528.00	1.26
20	600176	中国巨石	1,335,923.00	1.25

注:本项的"累计卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	209,374,059.68
卖出股票收入(成交)总额	92,773,574.95

注:"买入股票成本(成交)总额"、"卖出股票收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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，达到有效标跟踪标的指数的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	59,070.38
2	应收证券清算款	253,516.92
3	应收股利	-
4	应收利息	1,710.38
5	应收申购款	3,182.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	317,480.28

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.6 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。

8.12.7 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.8 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
安信复兴 100 指数	2,709	44,428.37	1,556,190.98	1.29	118,800,262.16	98.71

A						
安信复兴 100 指数 C	78	26,425.68	-	0.00	2,061,203.38	100.00
合计	2,780	44,035.13	1,556,190.98	1.27	120,861,465.54	98.73

注:机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信复兴 100 指数 A	-	-
	安信复兴 100 指数 C	-	-
	合计	-	-

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信复兴 100 指数 A	0
	安信复兴 100 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信复兴 100 指数 A	0
	安信复兴 100 指数 C	0
	合计	0

§10 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
基金合同生效日（2018 年 6 月 21 日）基金份额总额	423,283,899.93	35,117,929.67
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告	970,810.99	414,868.75

期期末基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	303,898,257.78	33,471,595.04
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	120,356,453.14	2,061,203.38

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

2、本报告期内，本基金托管行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币40,000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	171,802,921.14	56.89%	122,202.84	56.89%	-
海通证券	2	130,193,134.19	43.11%	92,607.46	43.11%	-
安信证券	2	2,797.00	0.00%	1.99	0.00%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	新增
国盛证券	2	-	-	-	-	新增
国信证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	新增
天风证券	2	-	-	-	-	新增
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	新增
中信建投	2	-	-	-	-	新增
中信证券	2	-	-	-	-	-

注:根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	1,163,800,000.00	88.58%	-	-
安信证券	-	-	150,100,000.00	11.42%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

安信基金管理有限责任公司

2019 年 03 月 29 日