# 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 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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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1月1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 | 安信工业4.0混合 | |
| 基金主代码 | 004521 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年7月20日 | |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 38,163,195.12份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 安信工业4.0混合A | 安信工业4.0混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004521 | 004522 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 24,546,172.89份 | 13,617,022.23份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要通过聚焦与工业4.0高度相关的优质标的,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金净资产的长期稳健增长。 |
| 投资策略 | 本基金所称的工业4.0主题投资涉及的企业类型包括但不限于以下四类:人工智能算法与数据供应商、硬件设备供应商、系统集成商和智慧工厂运营商等。<br>本基金通过综合考虑国内宏观经济趋势、利率变化趋势、国内股票市场估值水平、海外主要经济体经济和资本市场运行状况等因素,合理比较各大类资产风险收益比,确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具及其他投资品种的投资比例。本基金将自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上,结合收益率曲线变化,合理配置长、中、短期债券比例。本基金衍生品投资策略以风险控制为主。在资产支持证券投资策略上,本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×40%+恒生AH股H指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。<br>本基金可投资于港股通标的股票,从而面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 乔江辉 | 胡波 |
| | 联系电话 | 0755-82509999 | 021-61618888 |
| | 电子邮箱 | service@essencefund.com | Hubo@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008-088-088 | 95528 |
| 传真 | | 0755-82779292 | 021-63602540 |

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 期末可供出售证券投资公允价值变动额(扣税后) | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 3.1.2 期末对于在被投资单位具有控制、共同控制或重大影响权益性投资的账面价值 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 3.1.3 期末按照成本法核算的可供出售权益性投资的初始投资成本 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 3.1.4 期末可供出售债券投资的摊余成本 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 3.1.5 期末按照成本法核算的可供出售权益性投资的可收回金额 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 3.1.6 期末可供出售债券投资的可收回金额 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 3.1.7 期末持有的其他可供出售金融资产的风险准备 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 3.1.8 期末两年内曾经采用过风险准备核算且现仍用于弥补亏损的可供出售金融资产的风险准备余额 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

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

本报告期A股市场各指数均出现显著下跌,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,中美贸易摩擦是个长期的过程,过去数十年的全球化过程也有逆转的趋势。

其次是国内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解决过程缓慢。国内无风险利率居使出现一定的下行,也难以达到普惠的作用。

具体操作上,行业配置方面,本基金相对重配了猪养殖、电力设备、电子、黄金等行业。未来一段时间本基金将坚持在控制波动率的基础上努力获取绝对收益。

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0.7339元,本报告期基金份额净值增长率为-28.95%;截至本报告期末本基金C基金份额净值为0.7325元,本报告期基金份额净值增长率为-29.05%;同期业绩比较基准收益率为-10.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济环境看,我国经济已转入高质量发展阶段。不走举债发展的老路,尽管经济因此要承受短期阵痛,但可以换取长期的健康发展。整体而言,国内经济增长体现了较强的韧性。

中证全指市盈率已经回到2008年10月底的低位,历史分位降至10%附近,市净率已经跌破2008年10月底1664点的水平,历史分位处于1%的位置,具有一定的安全边际。但未来不确定性远超过往,具体投资策略方面我们将继续选择从估值和成长性的角度看基本合适的优秀公司。

具体而言,我们继续看好猪养殖行业的投资机会。猪周期是一个需求相对稳定,供给不断洗牌的利润率周期。目前处于行业底部,猪价比较差,销售渠道受阻,疫病风险在不断提高,推动周期向上反转。同时当前肉猪养殖板块在二级市场关注度已经十分的高,大多数投资者都在等待周期确定性到来的迹象显现。

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基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

本报告期内,本基金出现了连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,时间范围为2018年1月29日至2018年5月15日、2018年5月24日至2018年12月31日。

自2018年7月2日至2018年12月31日,本基金基金资产净值出现了连续60个工作日低于5000万元的情形,本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关解决方案上报中国证券监督管理委员会。

## §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

本报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对安信工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对安信工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内,由安信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §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:安信工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金
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 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 15,603,996.85 | 14,902,496.04 |
| 结算备付金 | 64,288.37 | 726,826.12 |
| 存出保证金 | 21,323.70 | 172,444.69 |
| 交易性金融资产 | 11,985,331.85 | 85,143,484.20 |
| 其中:股票投资 | 11,927,830.65 | 85,143,484.20 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 57,501.20 | - |
| 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 | 479,298.96 | - |
| 应收利息 | 6,820.53 | 9,231.90 |
| 应收股利 | 1,881.60 | - |
| 应收申购款 | - | 2,383.72 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 28,162,941.86 | 100,956,866.67 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017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 | 0.36 | - |
| 应付赎回款 | - | 423,712.43 |
| 应付管理人报酬 | 19,511.51 | 68,995.35 |
| 应付托管费 | 2,438.94 | 8,624.41 |
| 应付销售服务费 | 866.48 | 3,380.58 |
| 应付交易费用 | 30,704.24 | 301,695.73 |
| 应交税费 | 0.65 | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 120,000.00 | 105,743.45 |
| 负债合计 | 173,522.18 | 912,151.95 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 38,163,195.12 | 96,878,219.58 |
| 未分配利润 | -10,173,775.44 | 3,166,495.14 |
| 所有者权益合计 | 27,989,419.68 | 100,044,714.72 |
| 负债和所有者权益总计 | 28,162,941.86 | 100,956,866.67 |

注:报告期截止日2018年12月31日,本基金A类基金份额净值0.7339元,C类基金份额净值0.7325元,基金份额总额38,163,195.12份,其中A类基金份额24,546,172.89份,C类基金份额13,617,022.23份。

7.2 利润表

会计主体: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
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年7月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -7,182,866.52 | 9,233,820.00 |
| 1.利息收入 | 228,984.47 | 1,181,358.13 |
| 其中:存款利息收入 | 209,429.77 | 444,659.79 |
| 债券利息收入 | 36.75 | - |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 19,517.95 | 736,698.34 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -5,748,549.85 | 7,553,484.03 |
| 其中:股票投资收益 | -5,973,927.85 | 7,495,494.67 |
| 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 | 225,378.00 | 57,989.36 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -1,858,415.75 | 160,318.95 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 195,114.61 | 338,658.89 |
| 减:二、费用 | 889,995.60 | 1,728,074.71 |
| 1. 管理人报酬 | 282,525.07 | 565,350.88 |
| 2. 托管费 | 35,315.71 | 70,668.80 |
| 3. 销售服务费 | 8,438.74 | 32,069.83 |
| 4. 交易费用 | 390,599.01 | 922,118.77 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 税金及附加 | 0.18 | - |
| 7. 其他费用 | 173,116.89 | 137,866.43 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -8,072,862.12 | 7,505,745.29 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -8,072,862.12 | 7,505,745.29 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: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
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1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、期初所有者权益(基金净值) | 96,878,219.58 | 3,166,495.14 | 100,044,714.72 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -8,072,862.12 | -8,072,862.12 |
| 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) | -58,715,024.46 | -5,267,408.46 | -63,982,432.92 |
| 其中:1.基金申购款 | 40,155,233.86 | -2,416,805.98 | 37,738,427.88 |
| 2.基金赎回款 | -98,870,258.32 | -2,850,602.48 | -101,720,860.80 |
| 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) | 38,163,195.12 | -10,173,775.44 | 27,989,419.68 |

| 项目 | 上年度可比期间 2017年7月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 219,751,374.82 | - | 219,751,374.82 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 7,505,745.29 | 7,505,745.29 |
| 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) | -122,873,155.24 | -4,339,250.15 | -127,212,405.39 |
| 其中:1.基金申购款 | 36,358,616.02 | 1,352,395.84 | 37,711,011.86 |
| 2.基金赎回款 | -159,231,771.26 | -5,691,645.99 | -164,923,417.25 |
| 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) | 96,878,219.58 | 3,166,495.14 | 100,044,714.72 |

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

安信工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金(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")2015年7月13日下发的证监许可[2015]1614号文"关于准予安信工业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《安信工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合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。

本基金募集期间为2017年4月24日至2017年7月14日,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(2017)验字60962175_H06号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币219,706,104.91元。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2017年7月20日正式生效。截至2017年7月18日止,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219,706,104.91元,折合219,706,104.91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45,269.91元,折合45,269.91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116,077,871.48元,折合116,077,871.48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33,380.92元,折合33,380.92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103,628,233.43元,折合103,628,233.43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11,888.99元,折合11,888.99份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币219,751,374.82元,折合219,751,374.82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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生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)。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。本基金各类资产投资比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%(其中投资于香港联合交易所上市股票的投资比例占基金资产的0%-95%);本基金以工业4.0主题相关证券为主要投资对象,投资于工业4.0主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%;持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;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,本基金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。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×40%+恒生AH股H指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%

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年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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 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 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"浦发银行") | 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年7月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 282,525.07 | 565,350.88 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 49,025.62 | 68,857.81 |

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的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.80%/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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年7月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 35,315.71 | 70,668.80 |

注:基金托管费每日计提,按月支付。本基金的托管费均按前一日的基金资产净值的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

7.4.8.2.3 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1月1日至2018年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 安信工业4.0混合A | 安信工业4.0混合C | 合计 |
| 安信基金 | - | 6,210.22 | 6,210.22 |
| 安信证券 | - | 1,461.74 | 1,461.74 |
| 浦发银行 | - | - | - |
| 合计 | - | 7,671.96 | 7,671.96 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2017年7月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 安信工业4.0混合A | 安信工业4.0混合C | 合计 |
| 安信基金 | - | 27,772.09 | 27,772.09 |
| 安信证券 | - | 4,186.70 | 4,186.70 |
| 浦发银行 | - | - | - |
| 合计 | - | 31,958.79 | 31,958.79 |

注: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0.10%。本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%÷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类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额销售服务费每日计提,按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 安信工业4.0混合A | 安信工业4.0混合C |
| 基金合同生效日(2017年7月20日)持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | 11,862,396.20 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 11,862,396.20 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 31.0800% |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年07月20日至2017年12月31日 | 上年度可比期间 2017年07月20日至2017年12月31日 |
| | 安信工业4.0混合A | 安信工业4.0混合C |
| 基金合同生效日(2017年7月20日)持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - |

注:本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

7.4.8.4.2 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

本基金于本期末和上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 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1月1日至2018年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 浦发银行 | 15,603,996.85 | 205,105.11 | 14,902,496.04 | 333,837.97 |

注:本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管,按银行约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无从事交易所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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1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。

7.4.10.2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、存出保证金、买入返售金融资产、其他应收款项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的余额为人民币11,927,830.65元,划分为第二层级的余额为人民币57,501.20元,无划分为第三层级余额(于2017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的余额为人民币85,080,423.19元,划分为第二层级的余额为人民币63,061.01元,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。

第二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,本基金的资产净值为人民币27,989,419.68元,已连续超过六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定,向中国证监会说明原因和报送解决方案。

7.4.10.3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 | 11,927,830.65 | 42.35 |
| | 其中:股票 | 11,927,830.65 | 42.35 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 57,501.20 | 0.20 |
| | 其中:债券 | 57,501.20 | 0.20 |
| | 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 | 15,668,285.22 | 55.63 |
| 8 | 其他各项资产 | 509,324.79 | 1.81 |
| 9 | 合计 | 28,162,941.86 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(