安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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8月27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8月26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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至6月30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	37,448,771.58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	36,898,833.48份	549,938.10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

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

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	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	安信复兴100指数A	安信复兴100指数C
本期已实现收益	7,979,493.98	141,182.51
本期利润	21,958,519.04	354,403.36
加权平均基金份额本期利润	0.3022	0.2920
本期基金份额净值增长率	19.33%	19.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0389	0.0358
期末基金资产净值	38,333,611.20	569,619.90
期末基金份额净值	1.0389	1.0358

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。

3.2 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
过去一个月	2.82%	1.10%	2.02%	1.10%	0.80%	0.00%
过去三个月	-4.11%	1.50%	-6.01%	1.52%	1.90%	-0.02%
过去六个月	19.33%	1.47%	17.01%	1.49%	2.32%	-0.02%
过去一年	3.84%	1.41%	-2.98%	1.51%	6.82%	-0.10%
自基金合同生效起至今	3.89%	1.39%	-5.01%	1.51%	8.90%	-0.12%
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
过去一个月	2.80%	1.10%	2.02%	1.10%	0.78%	0.00%
过去三个月	-4.16%	1.50%	-6.01%	1.52%	1.85%	-0.02%
过去六个月	19.19%	1.47%	17.01%	1.49%	2.18%	-0.02%
过去一年	3.53%	1.41%	-2.98%	1.51%	6.51%	-0.10%
自基金合同生效起至今	3.58%	1.39%	-5.01%	1.51%	8.59%	-0.12%

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、本基金合同生效日为2018年6月21日。

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。

§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2019年6月30日,本基金管理人共管理48只开放式基金具体如下:安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、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)、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信本丰定期开放债券型证券投资基金、安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作新趋势主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、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、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金(原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金)、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、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证500指数增强型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深300指数增强型证券投资基金(安信新起点灵活配置混合型证券投资基金)、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率纯债债券型证券投资基金(LOF)。

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,基金量化投资部总经理	2018年6月21日	-	17	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经理。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。曾任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的基金经理;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理	2018年11月14日	-	8	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。曾任安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。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、上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

2、证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》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。

4.3.2 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

A股市场各指数上半年均出现显著上涨,其中海外资易摩擦有所反复对市场形成冲击,但与此同时政府应对国内外的不确定性迅速制定并实施了正确且有力的政策:首先全球贸易角度看,中美贸易谈判出现波折,但仍然向着好的可控的方向发展。其次是国内财政和货币政策应对得当,央行在稳商银行出现问题的时候,快速行动,一定程度上解决了实体融资难的问题,国内无风险利率回出现一定的下行,同时减税政策无论对于居民还是企业都是受益匪浅,中国历史上最大规模的减税影响很可能超出市场预期。

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1.0389元,本报告期基金份额净值增长率为19.33%;截至本报告期末本基金C基金份额净值为1.0358元,本报告期基金份额净值增长率为19.19%;同期业绩比较基准收益率为17.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,由于政策应对得当,我们认为国内外的经济形势相对平稳,好于市场预期。通胀水平有所上升但是也相对可控。市场对美国关税范围扩大至2000亿美元有一定预期,中国商务部也没有进一步跟进,人民币贬值一定程度上也能对冲关税影响,贸易战对市场风险偏好影响将逐渐钝化;信用债到期量平稳、"宽货币、紧信用"政策中宽货币持续发力,主动金融去杠杆节奏可控,后续去杠杆更多是结构性冲击。我们认为核心的有利因素在于A股估值处于合理偏低的位置,无论是沪深300指数市盈率约12倍,市净率约15倍,还是中证500指数的市盈率13倍,市净率约15倍,均已经跌入历史平均偏低水平。

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,建立健全估值流策体系,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致性。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债金融估值中心有限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2019年4月22日至2019年6月30日。

§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一安信基金管理有限责任公司2019年1月1日至2019年6月30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 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	2,856,597.59	7,567,560.69
结算备付金	8,107.87	6,955.92
存出保证金	32,373.99	59,070.38
交易性金融资产	36,278,361.35	99,366,885.23
其中:股票投资	36,278,361.35	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	94,918.87	253,516.92
应收利息	606.40	1,710.38
应收股利	-	-
应收申购款	548.03	3,182.60
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	39,271,514.10	107,258,882.12
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 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	180,115.39	91,358.44
应付管理人报酬	16,048.78	47,399.39
应付托管费	3,209.73	9,479.85
应付销售服务费	118.07	396.35
应付交易费用	40,864.02	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	127,927.01	190,000.22
负债合计	368,283.00	684,038.62
所有者权益:		
实收基金	37,448,771.58	122,417,656.52
未分配利润	1,454,459.52	-15,842,813.02
所有者权益合计	38,903,231.10	106,574,843.50
负债和所有者权益总计	39,271,514.10	107,258,882.12

注:报告期截止日2019年6月30日,本基金A类基金份额净值1.0389元,本基金C类基金份额净值1.0358元,本基金份额总额37,448,771.58份,其中A类基金份额36,898,833.48份,C类基金份额549,938.10份。

6.2 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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	22,941,569.04	274,677.40
1.利息收入	21,449.52	180,651.82
其中:存款利息收入	21,449.52	87,718.64
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	-	92,933.18
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	8,726,166.26	-
其中:股票投资收益	8,309,288.62	-
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	416,877.64	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	14,192,245.91	-337.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,707.35	94,362.58
减:二、费用	628,646.64	82,955.50
1. 管理人报酬	181,324.27	54,798.18
2. 托管费	36,264.87	10,959.62
3. 销售服务费	1,487.42	2,164.84
4. 交易费用	227,537.57	2.25
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	182,032.51	15,030.61
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	22,312,922.40	191,721.90
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	22,312,922.40	191,721.90

6.3 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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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)	122,417,656.52	-15,842,813.02	106,574,843.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,312,922.40	22,312,922.40
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)	-84,968,884.94	-5,015,649.86	-89,984,534.80
其中:1.基金申购款	3,088,141.71	135,734.60	3,223,876.31
2.基金赎回款	-88,057,026.65	-5,151,384.46	-93,208,411.11
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)	37,448,771.58	1,454,459.52	38,903,231.10
项目	上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年6月30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)	458,401,829.60	-	458,401,829.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	191,721.90	191,721.90
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)	-125,718,533.13	-12,571.67	-125,731,104.80
其中:1.基金申购款	99,157.08	9.92	99,167.00
2.基金赎回款	-125,817,690.21	-12,581.59	-125,830,271.80
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)	332,683,296.47	179,150.23	332,862,446.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1 至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 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"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")2018年2月2日下发的证监许可[2018]247号文《关于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批复》的核准,由基金管理人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。

本基金募集期间为2018年5月7日至2018年6月15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[2018]验字60062175_H10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458,147,902.60元。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2018年6月21日正式生效。截至2018年6月20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为人民币253,927.00元,折合253,927.00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。本基金根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为C类基金份额。A类和C类基金份额分别设置代码。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金合同的有关规定,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)。

本基金的业绩比较基准: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%。

6.4.2 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。

6.4.3 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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

6.4.6.2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。

6.4.6.3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。

6.4.6.4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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	-	[illegible]	[illegible]

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年6月30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	-	-

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	181,324.27	54,798.18
其中:支付销售机构的客户维护费	106,691.22	26,953.84

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,264.87	10,959.62

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

6.4.8.2.3 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 2019年1月1日至2019年6月30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
中国农业银行	-	897.23	897.23
安信基金	-	-	-
合计	-	897.23	897.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年6月30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
中国农业银行	-	78.66	78.66
安信基金	-	616.63	616.63
合计	-	695.29	695.29

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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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

[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

注:本基金的银行存款由基