

安信中证复兴发展100主题指数型 证券投资基金清算报告

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

清算报告出具日：2020年2月19日

清算报告公告日：2020年3月12日

§ 1 重要提示

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”）2018 年 2 月 2 日证监许可【2018】247 号文准予募集注册，并经机构部函[2018]1448 号确认，自 2018 年 6 月 21 日起基金合同生效，本基金基金管理人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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的有关规定及《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当终止《基金合同》，并根据《基金合同》第十九部分的约定进行财产清算，而无须召开基金份额持有人大会，同时向中国证监会报告。截至 2020 年 2 月 5 日，本基金基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元，触发基金合同中约定的终止条款。

由本基金的基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成本基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

§ 2 基金概况

基金名称	安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金
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
报告期末(2020 年 2 月 5 日)基金份额总额	19,169,370.18 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。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%（指年收益率，评价时按期间折算）。	
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。	
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的有关规定及《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。	
基金管理人名称	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人名称	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(2020 年 2 月 5 日)下属分级基金的份额总额	8,467,007.78 份	10,702,362.40 份

§ 3 基金运作情况

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”）2018 年 2 月 2 日证监许可【2018】247 号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自 2018 年 5 月 7 日至 2018 年 6 月 15 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2018 年 6 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 458,401,829.60 份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合 253,927.00 份基金份额）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的有关规定及《基金合同》的约定，《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当终止《基金合同》，并根据《基金合同》第十九部分的约定进行财产清算，而无须召开基金份额持有人大会，同时向中国证监会报告。截至 2020 年 2 月 5 日，本基金基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元，触发基金合同中约定的终止条款。本基金的最后运作日为 2020 年 2 月 5 日，并于 2020 年 2 月 6 日进入清算程序。

自基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

§ 4 财务会计报告

4.1 最后运作日资产负债表（经审计）

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：2020 年 2 月 5 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2020年2月5日
资 产：	
银行存款	28,031,001.33
结算备付金	12,858.06
存出保证金	12,587.66
交易性金融资产	16,019,400.95
其中：股票投资	16,019,400.95
应收利息	5,505.88
资产总计	44,081,353.88
	最后运作日 2020年2月5日
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	23,739,416.61
应付赎回费	3,762.76
应付管理人报酬	22,708.62
应付托管费	4,541.71
应付销售服务费	7,006.00
应付交易费用	20,250.32
应付指数使用费	69,780.22
审计费	31,967.04
负债合计	23,899,433.28
所有者权益：	
实收基金	19,169,370.18
未分配利润	1,012,550.42
所有者权益合计	20,181,920.60
负债和所有者权益总计	44,081,353.88

注：1、报告截止日 2020 年 2 月 5 日(基金最后运作日)，本基金 A 类基金份额净值 1.0554 元，本基金 C 类基金份额净值 1.0508 元，本基金份额总额 19,169,370.18 份，其中 A 类基金份额 8,467,007.78 份，C 类基金份额 10,702,362.40 份。

2、本财务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安永华明(2020)专字第 60962175_H01 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

自最后运作日后至 2020 年 2 月 11 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金人民币 12,858.06 元，为存放于上海证券交易所和深圳证券交易所的结算备付金。该款项预计将于证券账户销户时调回托管户，并于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币 12,587.66 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的结算保证金。该款项预计将于证券账户销户时调回托管户，并于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 16,019,400.95 元，已于 2020 年 2 月 7 日全部卖出变现。股票变现损益归基金资产所有，股票卖出产生的费用由基金资产承担。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为人民币 5,505.88 元。其中应收银行存款利息人民币 5,313.49 元，应收结算备付金利息人民币 156.86 元，应收存出保证金利息人民币 35.53 元，该款项预计将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 23,739,416.61 元，该款项已分别于 2020 年 2 月 6 日、2020 年 2 月 7 日、2020 年 2 月 10 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 22,708.62 元，该款项预计将于首次清算结束后支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,541.71 元，该款项预计将于首次清算结束后支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 7,006.00 元，该款项预计将于首次清算结束后支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 20,250.32 元，为应付兴业证券交易费用，该款项预计将于首次清算结束后支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债为人民币 105,510.02 元，其中应付赎回费为人民币

3,762.76 元，该款项已分别于 2020 年 2 月 6 日、2020 年 2 月 7 日支付；应付指数使用费人民币 69,780.22 元，该款项将于收到指数使用费发票后支付；预提清算审计费为人民币 31,967.04 元，该款项预计将于首次清算结束后支付。

5.3 其他情况

本基金于 1 月 16 日、1 月 22 日和 1 月 23 日分别参与了良品铺子（603719.SH）、双飞股份（300817.SZ）和雪龙集团（603949.SH）的新股询价并且成为有效报价，按照主承的公告时间安排，本基金仍需完成新股缴款业务，其明细如下：

单位：人民币元

股票代码	股票名称	缴款日期	缴款金额
300817	双飞股份	2020 年 2 月 10 日	5,933.51
603719	良品铺子	2020 年 2 月 14 日	4,117.40
603949	雪龙集团	2020 年 3 月 2 日	234,210.00

注：其中雪龙集团（603949）按照中签率为 0.5%进行估算，实际缴款金额将以发行结果公告为准。

待上述新股上市、变现完毕后，基金管理人将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

5.4 清算期间的清算损益情况

项目	自2020年2月6日至2020年2月11日止清算期间
一、清算收益	
利息收入（注1）	2,428.09
公允价值变动损益	174,959.68
赎回费收入	5.67
投资收益	160,847.33
清算收入小计	338,240.77
二、清算费用	-
股票变现交易费用	29,441.96
清算费用小计	29,441.96
三、清算净收益	308,798.81

注：利息收入系计提的自 2020 年 2 月 6 日至 2020 年 2 月 11 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2020年2月5日基金净资产	20,181,920.60
加：清算期间净收益	308,798.81
减：基金净赎回金额（于2020年2月6日确认的投资者赎回申请）	2,090,331.13
二、2020年2月11日基金净资产	18,400,388.28

注：截至 2020 年 2 月 11 日，本基金资产净值 18,400,388.28 元，其中 A 类基金资产净值

6,985,119.41 元，C 类基金资产净值 11,415,268.87 元；基金份额总额 17,188,671.55 份，其中 A 类基金份额 6,507,646.57 份，C 类基金份额 10,681,024.98 份。

根据《基金合同》、《安信基金管理有限责任公司关于安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款以及清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2020 年 2 月 11 日止的剩余财产为人民币 18,400,388.28 元，其中包括未变现资产：结算备付金人民币 12,858.06 元、存出保证金人民币 12,587.66 元、交易性金融资产人民币 5,933.51 元（该金额为新股上市前成本法估值金额，与新股实际变现金额可能存在差异），应收银行存款、结算备付金、存出保证金利息人民币 7,933.97 元。预计新股中签待缴款金额为人民币 238,327.40 元，首次可清算金额为人民币 18,122,747.68 元，其中 A 类份额首次可清算金额为人民币 6,879,722.03 元，C 类份额首次可清算金额为人民币 11,243,025.65 元。

上述剩余未变现的资产及新股缴款预留款项共计人民币 277,640.60 元，将根据实际变现情况扣除相应的清算费用和相关税费后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配进行二次或多次清算。

5.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、《安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海通力律师事务所关于〈安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

6.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

6.3 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和中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 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>

安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二〇年二月十九日