

江信汇福定期开放债券型证券投资基金2016年年度报告摘要

2016年12月31日

基金管理人：江信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2017年3月31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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月30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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

大华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2016年5月5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	江信汇福
基金主代码	002448
基金运作方式	契约型开放式, 本基金合同生效后, 每封闭运作3个月, 集中开放一次申购和赎回。
基金合同生效日	2016年5月5日
基金管理人	江信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	505,181,779.27
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上, 通过主动管理, 力争创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>由于本基金存在开放期与封闭期, 在开放期与封闭期将实行不同的投资策略。</p> <p>在开放期内本基金为保持较高的组合流动性, 方便投资人安排投资, 在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下, 将主要投资于高流动性的投资品种, 减小基金净值的波动。</p> <p>在封闭期内的投资将依托基金管理人自身信用评级体系和信用风险控制措施。采用自上而下和自下而上相结合的投资策略, 实现风险和收益的最佳配比。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为: 同期中国人民银行公布的3个月期定期存款基准利率(税后)×2。本基金的业绩比较基准将在每一封闭期的第一个工作日, 根据中国人民银行公布的金融机构人民币利率进行最新调整。
风险收益特征	本基金为债券型基金, 属于证券市场中的较低风险品种, 预期收益和预期风险高于货币市场基金, 低于混合型基金和股票型基金。

### 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	江信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛建宇
	联系电话	010-57380902
	电子邮箱	maojianyu@jxfund.cn
客户服务电话	400-622-0583	95595
传真	010-57380988	010-63639132

### 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.jxfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## §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	2016年5月5日-2016年12月31日
本期已实现收益	7,295,677.22
本期利润	-12,627,535.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0372
本期基金份额净值增长率	-0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0335
期末基金资产净值	488,253,911.55
期末基金份额净值	0.9665

注：1、本基金基金合同生效日为2016年5月5日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

2、所述基金业绩指标不包括持有人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。

3、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。

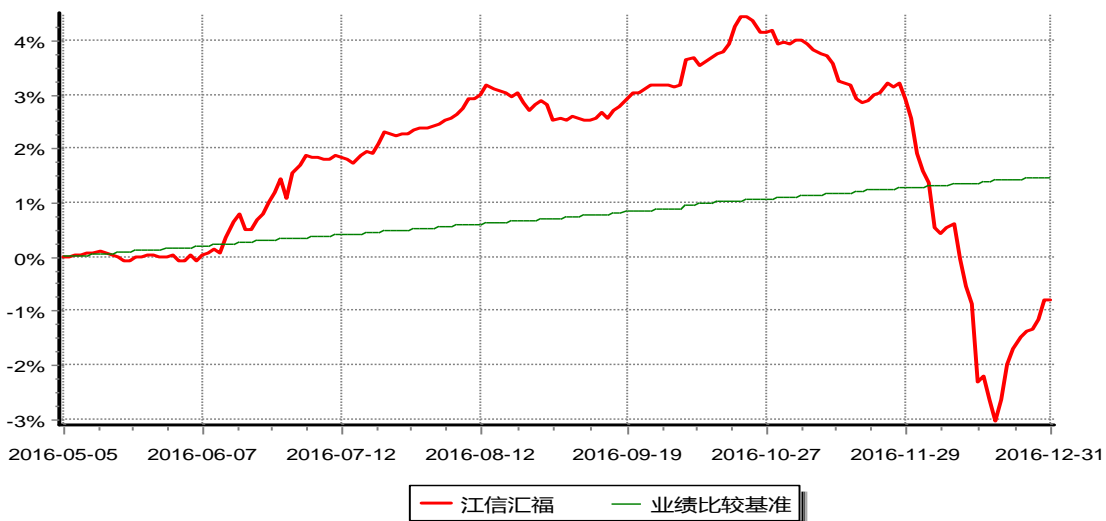
4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”指报告期最后一日，即12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 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

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	-3.83%	0.32%	0.56%	0.01%	-4.39%	0.31%
过去六个月	-2.33%	0.24%	1.13%	0.01%	-3.46%	0.23%
自基金合同生效日起至今（2016年05月05日-2016年12月31日）	-0.80%	0.22%	1.48%	0.01%	-2.28%	0.21%

#### 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

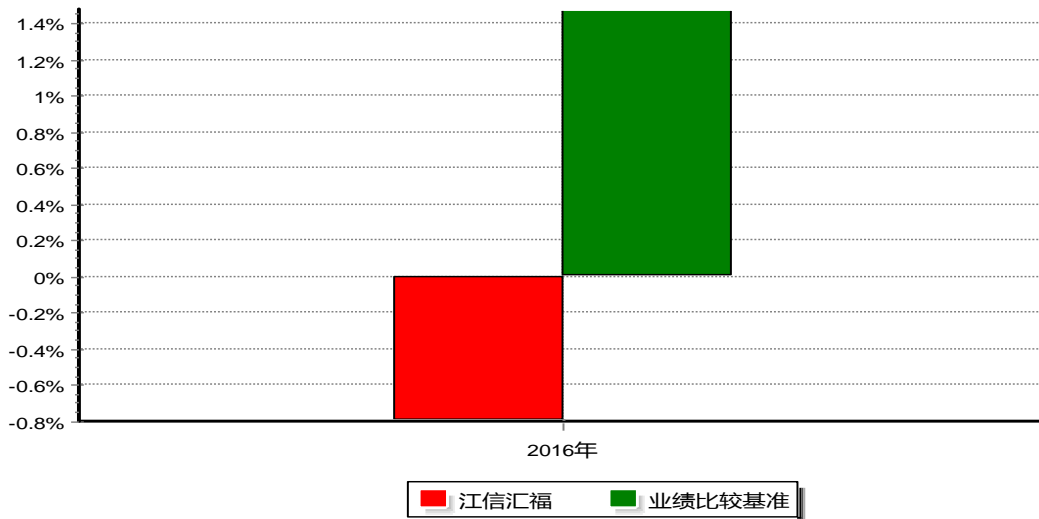


注：1、本基金基金合同生效日为2016年5月5日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2016年5月5日至2016年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比

例将符合基金合同中关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关约定：本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，本基金不受前述比例限制。开放期内本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券资产占基金资产净值的比例不低于5%（在封闭期内，本基金不受此限制）。

### 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.265	6,769,520.16	858,908.14	7,628,428.30	
合计	0.265	6,769,520.16	858,908.14	7,628,428.30	

## § 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

江信基金管理有限公司是2012年12月经中国证监会（证监基字[2012]1717号文）批准设立的基金管理公司，注册资本1.8亿元人民币，股东为：国盛证券有限责任公司、恒生阳光集团有限公司、金麒麟投资有限公司、鹰潭红石投资管理有限合伙企业、鹰潭聚福投资管理有限合伙企业。目前，各家持股比例分别为：30%、17.5%、17.5%、17.5%、

17.5%。公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2016年12月31日，本基金管理人管理的开放式基金为：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金、江信祺福债券型证券投资基金、江信添福债券型证券投资基金、江信洪福债券型证券投资基金。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

#### 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		
郑昱	本基金的基金经理，公司固定收益投资总监	2014年5月29日	—	17	郑昱先生，中共党员，博士。曾任青海证券有限责任公司研究员，江南证券有限责任公司研究所研究员、副所长，江西江南信托股份有限公司固定收益部副总经理、总经理，中航信托股份有限公司固定收益部总经理，现任江信基金管理有限公司固定收益投资总监。

注：1、该基金经理自基金合同生效日起即任职，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无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

为保护各类投资人的利益，公平对待各类投资人，避免不正当关联交易、利益输送

等违法违规行为，本公司根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《江信基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。

本报告期，根据“时间优先，价格优先”原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人坚持公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《江信基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定。

本基金管理人通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，本基金未出现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生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超过该证券当日成交量的5%的情况。

### 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

2016年债券市场呈现先涨后跌的行情，在10月下旬之前，市场整体呈现上涨行情，在配置盘的推动下，收益率下行，信用利差收窄，进入四季度后债市受海内外多重因素影响呈现下跌行情。一方面市场担忧通胀上行压力增加，货币政策宽松程度有限，加之监管重点推进降杠杆，引导资金脱虚向实，债券市场出现一定幅度调整。另一方面美国总统选举结果引发全球资产价格动荡，同时市场预期美联储加息节奏加快，主要发达国家货币政策预期收紧，外围不确定性加剧国内债市调整。本基金在报告期内，重点配置利率债，保持一定的杠杆率。展望未来，我们对债券市场持谨慎乐观态度，从长期的角



度看，支持债券市场向好的因素并没有根本改变，但是也需要对市场短期扰动因素予以足够的重视，本基金未来保持灵活的杠杆比例和期限结构，波段投资利率债，严控信用风险，并兼顾投资组合的流动性和收益性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日，本基金份额净值为0.9665元，本报告期份额净值增长率为-0.8%，同期业绩比较基准增长率为1.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，今年货币政策的主基调为稳健中性，全社会债务水平与地方债务置换压力均不支持央行大幅提高融资成本。汇率方面，年初以来人民银行加强了汇率管理，资本外流压力有所减弱。预计人民币上半年将随美元指数保持震荡态势，下半年受制于美联储加息、国内经济再度下行等因素影响，仍有被动贬值压力。基本面方面，PPI向CPI的传导仍然有限，通胀不存在持续大幅走高的基础。受房地产调控政策影响，地产销售和投资增速或将逐步放缓。居民可支配收入增速下滑对消费增长形成约束。财政收支压力下，基建高增长难以为继，经济缺乏内生增长动力，下行压力仍存。债券收益率上行有顶，长期依旧乐观看待债券市场。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会负责人为公司总经理，成员包括投资管理总部、运营保障总部、研究发展部、风控稽核总部、证券交易部等部门的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的80%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；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；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本基金于2016年8月1日进行了2016年度第一次收益分配，每10份基金份额派0.145元；于2016年10月31日进行了2016年度第二次收益分配，每10份基金份额派0.120元。

## § 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

中国光大银行股份有限公司在江信汇福定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《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》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对江信汇福定期开放债券型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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

中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《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》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人-江信基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人-江信基金管理有限公司编制的“江信汇福定期开放债券型证券投资基金2016年年报”进行了复核，报告中相关财务指标、

净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

## § 6 审计报告

大华会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师李永伟、陈静2017年3月17日对本基金2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注出具了大华审字[2017]004041号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：江信汇福定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	57,071.77
结算备付金		5,328,544.33
存出保证金		75,271.04
交易性金融资产	7.4.7.2	859,770,188.49
其中：股票投资		—
基金投资		—
债券投资		859,770,188.49
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	24,107,169.54
应收股利		—
应收申购款		—

递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		889,338,245.17
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		399,199,760.00
应付证券清算款		—
应付赎回款		—
应付管理人报酬		666,812.41
应付托管费		222,270.79
应付销售服务费		333,406.18
应付交易费用	7.4.7.7	6,460.07
应交税费		—
应付利息		515,624.17
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	140,000.00
负债合计		401,084,333.62
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	505,181,779.27
未分配利润	7.4.7.10	-16,927,867.72
所有者权益合计		488,253,911.55
负债和所有者权益总计		889,338,245.17

## 7.2 利润表

会计主体：江信汇福定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016年5月5日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年5月5日至2016年12月31日
<b>一、收入</b>		-6,706,440.84
1. 利息收入		10,918,790.54
其中：存款利息收入	7.4.7.11	110,186.33
债券利息收入		10,611,769.07
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		196,835.14
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,939,088.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—
基金投资收益	7.4.7.13	—
债券投资收益	7.4.7.14	1,939,088.53
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益	7.4.7.15	—
衍生工具收益	7.4.7.16	—
股利收益	7.4.7.17	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-19,923,213.10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	358,893.19
<b>减：二、费用</b>		5,921,095.04
1. 管理人报酬		1,335,783.61
2. 托管费		445,261.17

3. 销售服务费		667,891.81
4. 交易费用	7.4.7.20	8,373.27
5. 利息支出		3,308,385.18
其中: 卖出回购金融资产支出		3,308,385.18
6. 其他费用	7.4.7.21	155,400.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-12,627,535.88
减: 所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-12,627,535.88

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 江信汇福定期开放债券型证券投资基金

本报告期: 2016年5月5日至2016年12月31日

单位: 人民币元

项 目	本期 2016年5月5日至2016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)	223,115,342.17	—	223,115,342.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-12,627,535.88	-12,627,535.88
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)	282,066,437.10	3,328,096.46	285,394,533.56
其中: 1. 基金申购款	373,778,826.79	4,394,217.18	378,173,043.97
2. 基金赎回款	-91,712,389.69	-1,066,120.72	-92,778,510.41
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)	—	-7,628,428.30	-7,628,428.30
五、期末所有者权益(基金净值)	505,181,779.27	-16,927,867.72	488,253,911.55

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：

初英

付明

刘健菲

-----  
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

江信汇福定期开放债券型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可【2015】788号文《关于核准江信汇福定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由江信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《江信汇福定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,定期开放申购和赎回,首次设立募集不包括认购资金利息共募集223,100,487.07元,已经大华会计师事务所(特殊普通合伙)大华验字[2016]000358号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《江信汇福定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年5月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为223,115,342.17份基金份额,其中认购资金利息折合14,855.10基金份额。本基金的基金管理人为江信基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的国债、中央银行票据、政策性金融债券、商业银行金融债券、商业银行次级债、短期融资券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购、中期票据、银行存款等固定收益类资产,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)。本基金不直接买入股票、权证等权益类资产,但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资可分离交易可转债而产生的权证等。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于80%,但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,本基金不受前述比例限制。开放期内本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券资产占基金资产净值的比例不低于5%(在封闭期内,本基金不受此限制)。

本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的3个月期定期存款基准利率(税后)×2。本基金的业绩比较基准将在每一封闭期的第一个工作日,根据中国人民银行公布的金融机构人民币利率进行最新调整。

本财务报表由本基金的基金管理人江信基金管理有限公司于2017年3月17日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》和具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《江信汇福定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年5月5日至2016年12月31日止期间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2016年12月31日的财务状况以及2016年5月5日至2016年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2016年5月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍



生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允

价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行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变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

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在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国盛证券有限责任公司	管理人的股东
恒生阳光集团有限公司	管理人的股东
金麒麟投资有限公司	管理人的股东
鹰潭聚福投资管理有限合伙企业	管理人的股东
鹰潭红石投资管理有限合伙企业	管理人的股东
江信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
广东国盛金控集团股份有限公司	管理人股东的股东

注：（1）下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）本报告期（2016年5月5日至2016年12月31日）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。关联方关系变化如下：

变化前：

关联方名称	与本基金的关系
国盛证券有限责任公司	管理人的股东
恒生阳光集团有限公司	管理人的股东
金麒麟投资有限公司	管理人的股东
鹰潭聚福投资管理有限合伙企业	管理人的股东
鹰潭红石投资管理有限合伙企业	管理人的股东
江信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中江国际信托股份有限公司	管理人股东的股东

变化后：

关联方名称	与本基金的关系
国盛证券有限责任公司	管理人的股东
恒生阳光集团有限公司	管理人的股东
金麒麟投资有限公司	管理人的股东
鹰潭聚福投资管理有限合伙企业	管理人的股东
鹰潭红石投资管理有限合伙企业	管理人的股东
江信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中江国际信托股份有限公司	管理人股东的股东

#### 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

本期本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本期本基金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 2016年5月5日至2016年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	1,335,783.61
其中:支付销售机构的客户维护费	237,083.34

注:基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提,基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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
	2016年5月5日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	445,261.17

注:基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提,基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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
	2016年5月5日至2016年12月31日
当期应支付的销售服务费	
国盛证券有限责任公司	207,643.99
中国光大银行股份有限公司	96,212.58
江信基金管理有限公司	107,541.70
合计	411,398.27

注：本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E前一日基金资产净值

#### 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

本报告期（2016年5月5日至2016年12月31日）本基金无与关联方进行银行间同业市场的债券（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

本报告期（2016年5月5日至2016年12月31日）内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国盛证券有限责任公司	20,000,388.88	3.96%
中江国际信托股份有限公司	20,001,361.11	3.96%

##### 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 2016年5月5日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	57,071.77	38,658.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期（2016年5月5日至2016年12月31日）本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本期本基金无其他关联交易事项的说明。

**7.4.9 期末（2016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**

本期末（2016年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本期末（2016年12月31日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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2016年12月31日止，本基金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79,999,760.00元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
140210	14国开10	2017-01-05	107.65	800,000	86,120,000.00
合计				800,000	86,120,000.00

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2016年12月31日止，基金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319,200,000.00元，于2017年1月3日、2017年1月4日和2017年1月5号先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

(1) 公允价值



## (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

## (ii) 各层级金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为13,026,188.49元，属于第二层级的余额为846,744,000.00元，无属于第三层级的余额。

## (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

## (iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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。

## § 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	—	—

	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	859,770,188.49	96.68
	其中：债券	859,770,188.49	96.68
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	5,385,616.10	0.61
7	其他各项资产	24,182,440.58	2.72
8	合计	889,338,245.17	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（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
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	—	—
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	—	—

注：本期末（2016年12月31日），本基金未持有股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本期末（2016年12月31日），本基金未持有沪港通股票。

### 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

本期末（2016年12月31日），本基金未持有股票。

### 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

本期末（2016年12月31日），本基金未持有股票。

#### 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

本期末（2016年12月31日），本基金未持有股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本期末（2016年12月31日），本基金未持有股票。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	356,946,000.00	73.11
2	央行票据	—	—
3	金融债券	304,136,000.00	62.29
	其中：政策性金融债	304,136,000.00	62.29
4	企业债券	190,789,750.00	39.08

5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	7,898,438.49	1.62
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	859,770,188.49	176.09

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140210	14国开10	1,000,000	107,650,000.00	22.05
2	160408	16农发08	1,000,000	96,380,000.00	19.74
3	019514	15国债14	800,000	81,432,000.00	16.68
4	019502	15国债02	700,000	71,337,000.00	14.61
5	019507	15国债07	500,000	51,715,000.00	10.59

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本期末（2016年12月31日），本基金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

本期末（2016年12月31日），本基金未持有贵金属。

#### 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

本期末（2016年12月31日），本基金未持有权证。

#### 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

本期末（2016年12月31日），本基金未持有股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本期末（2016年12月31日），本基金未持有股指期货。

**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**

本期末（2016年12月31日），本基金未持有国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本期末（2016年12月31日），本基金未持有国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本期末（2016年12月31日），本基金未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**8.12.2** 本期末（2016年12月31日），本基金未持有股票。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	75,271.04
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	24,107,169.54
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	24,182,440.58

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128013	洪涛转债	7,898,438.49	1.62

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本期末（2016年12月31日），本基金未持有股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本报告期不存在投资流通受限证券违反相关法规或本基金管理公司的规定的情形，不存在投资托管行股票、投资控股股东主承销的证券、从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证的情形。

## §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

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
6,323	79,895.9	138,896,406.6 3	27.49%	366,285,372.6 4	72.51%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	182,137.11	0.04%

### 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年5月5日)基金份额总额	223,115,342.17
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	373,778,826.79
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	91,712,389.69
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	505,181,779.27

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开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

在本报告期内，本基金无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，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

本基金聘请的大华会计师事务所（特殊普通合伙）为第1年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的审计费为人民币肆万（40,000.00）元整。

### 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，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

### 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	占股票成交总额比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
广发证券	1	—	—	—	—	
国盛证券	1	—	—	—	—	
民族证券	1	—	—	—	—	

## 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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
广发证券	16,142,866.49	1.84%	—	—	—	—
国盛证券	829,608,200.00	94.68%	5,094,400,000.00	41.40%	—	—
民族证券	30,434,099.80	3.47%	7,212,200,000.00	58.60%	—	—

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

江信基金管理有限公司  
二〇一七年三月三十一日