

江信祺福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03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7月27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 | 江信祺福 | |
| 基金主代码 | 002723 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年07月27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 | 219,313,108.66份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 江信祺福A | 江信祺福C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002723 | 002724 |
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 210,572,370.09份 | 8,740,738.57份 |

注：本基金A类基金份额在认/申购时收取基金认/申购费用；C类基金份额不收取认/申购费而是在《基金合同》生效后从本类别基金资产中计提销售服务费。

2.2 基金产品说明

| | | |
|--------------|---|-------------|
| 投资目标 | 严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，给投资人带来长期的现金红利收益。 | |
| 投资策略 | 本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×20% +中债全债指数×80%。 | |
| 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。 | |
| 下属分级基金的风险收益特 | 本基金为债券型基金，属 | 本基金为债券型基金，属 |

| | | |
|---|--|--|
| 征 | 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。 | 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 | 张建春 |
| | 联系电话 | 010-57380902 | 010-63639180 |
| | 电子邮箱 | maojianyu@jxfund.cn | zhangjianchun@cebbank.com |
| 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07月27日-2016年 12月31日 | 2016年07月27日-2016年 12月31日 |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 江信祺福A | 江信祺福C |
| 本期已实现收益 | 3,601,908.59 | 267,971.67 |
| 本期利润 | -2,200,842.64 | 37,385.64 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0108 | 0.0021 |

| | | |
|----------------------|----------------|--------------|
| 本期基金份额净值增长率 | -0.98% | -1.19% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | 2016年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0098 | -0.0119 |
| 期末基金资产净值 | 208,509,204.67 | 8,636,617.22 |
| 期末基金份额净值 | 0.9902 | 0.9881 |

注：1、本基金基金合同生效日为2016年7月27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认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。

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 (江信祺福A) | 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 | -1.86% | 0.15% | -1.72% | 0.25% | -0.14% | -0.10% |
| 自基金合同生效日起至今（2016年07月27日-2016年12月31日） | -0.98% | 0.12% | -1.30% | 0.23% | 0.32% | -0.11% |

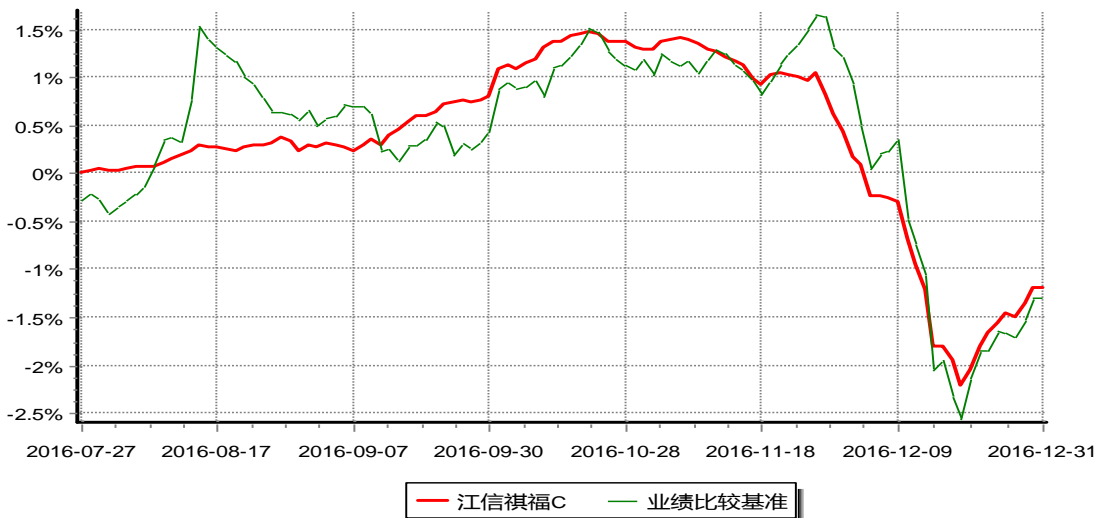
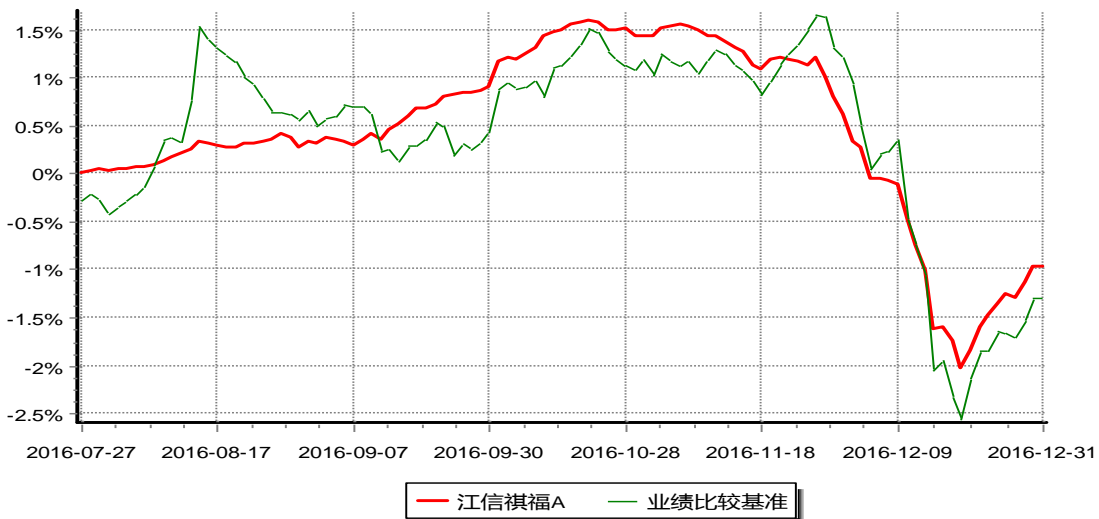
| 阶段 (江信祺福C) | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -1.98% | 0.15% | -1.72% | 0.25% | -0.26% | -0.10% |
| 自基金合同生效日起 | -1.19% | 0.12% | -1.30% | 0.23% | 0.11% | -0.11% |

| | | | | | | |
|-----------------------------|--|--|--|--|--|--|
| 至今（2016年07月27日-2016年12月31日） | | | | | | |
|-----------------------------|--|--|--|--|--|--|

注：1、本基金基金合同生效日为2016年7月27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7月27日至2016年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中基金投资组合比例限制中规定的各项比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资权益类资产（包括股票、权证等）比例不高于基金资产的20%，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

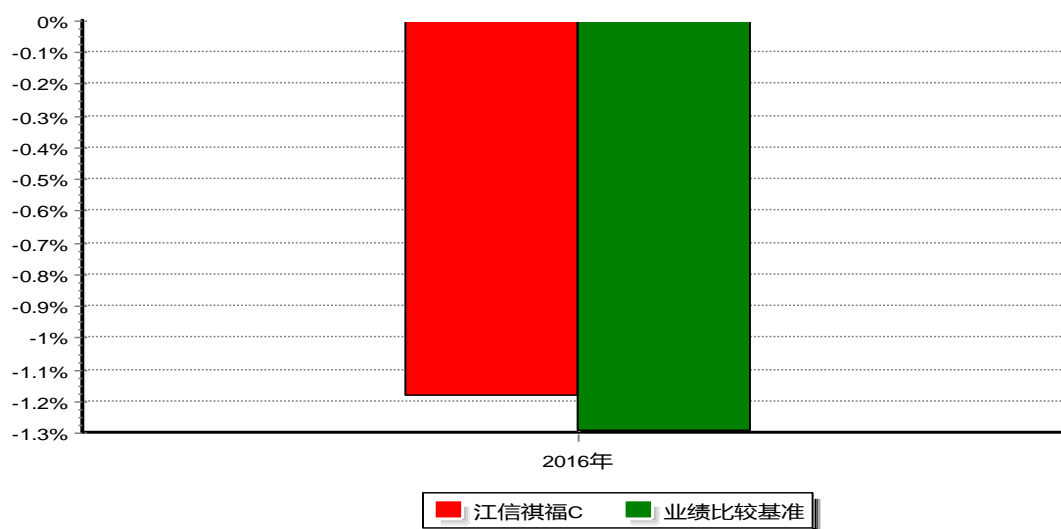
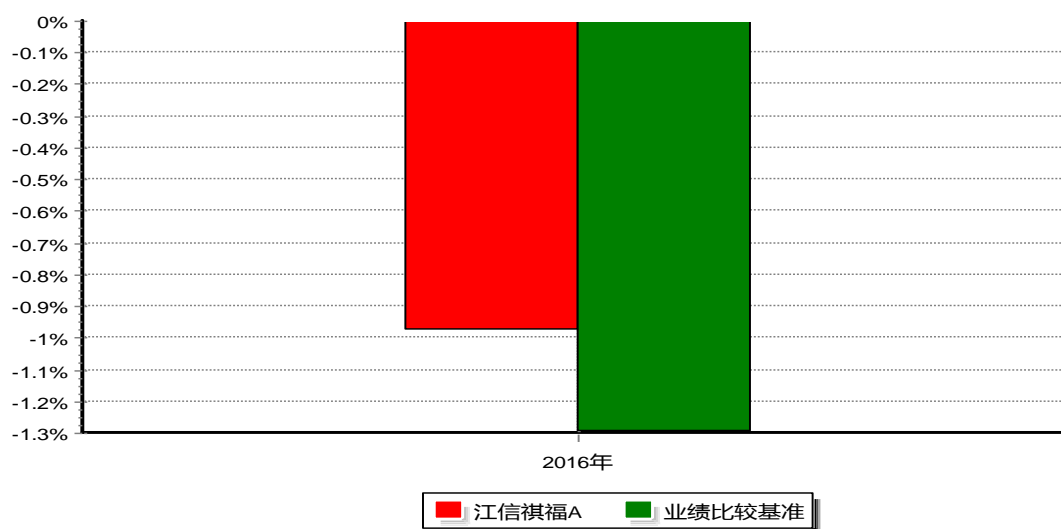
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较



注：1、本基金基金合同生效日为2016年7月27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7月27日至2016年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中基金投资组合比例限制中规定的各项比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资权益类资产（包括股票、权证等）比例不高于基金资产的20%，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

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：本基金合同于2016年7月27日生效，本期按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

§ 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 | | |
| 杨淳 | 本基金的基金经理，公司固定收益投资总监助理 | 2016年07月27日 | — | 10年 | 杨淳先生，金融学硕士，曾先后就职于北京天相投资顾问有限公司任行业研究员、中金瑞盈资产管理有限公司任证券分析师、国盛证券有限责任公司研究所任证券分析师、江信基金管理有限公司任研究部固定收益研究员，现任江信基金管理有限公司固定收益投资总监助理，并担任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、江信洪福纯债债券型证券投资基金基金经理。 |
| 静鹏 | 本基金的基金 | 2016年07月27日 | — | 5年 | 静鹏先生，毕业于清华大学。曾先后就职于洛肯国 |

| | | | | | |
|--|----|--|--|--|--|
| | 经理 | | | | 际投资管理有限公司任债券交易员、博润银泰投资管理有限公司任债券交易员、江信基金管理有限公司任债券交易员，现任江信祺福债券型证券投资基金、江信洪福纯债债券型证券投资基金基金经理。 |
|--|----|--|--|--|--|

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遵规守信情况的说明

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。股票市场在年初经历熔断之后，全年走出震荡上行的趋势，以有业绩支撑的真成长股和绩优蓝筹股表现较好。报告期内，本基金维持相对适中的权益配置比例，固定收益方面保持灵活的杠杆比例，控制投资组合久期，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

基金合同生效日（2016年7月27日）截至2016年12月31日，本基金A类基金份额净值为0.9902元，本报告期份额净值增长率为-0.98%，C类基金份额净值为0.9881元，本报告期份额净值增长率为-1.19%，同期业绩比较基准增长率为-1.30%。

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。权益方面，重点布局业绩稳健蓝筹股，看好国企改革，供给侧改革收益行业。

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历。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6次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的50%，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；同一类别的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。本报告期末，尚存可供分配的利润共元，滚存至下一期进行分配。

§ 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祺福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，对江信祺福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“江信祺福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]004040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：江信祺福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 |
|------|---------|--------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 2,351,654.81 |

| | | |
|-----------------|------------|----------------------------|
| 结算备付金 | | 2,094,693.23 |
| 存出保证金 | | 26,989.06 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 265,624,994.00 |
| 其中：股票投资 | | 11,470,234.00 |
| 基金投资 | | — |
| 债券投资 | | 254,154,760.00 |
| 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 | 6,355,209.19 |
| 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 | | 276,453,540.29 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 |
| 负 债： | | |
| 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 | | 57,799,754.88 |
| 应付证券清算款 | | 1,203,959.18 |
| 应付赎回款 | | 1,006.42 |
| 应付管理人报酬 | | 92,570.47 |
| 应付托管费 | | 27,771.13 |
| 应付销售服务费 | | 4,067.19 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 18,418.16 |
| 应交税费 | | — |

| | | |
|---------------|----------|----------------|
| 应付利息 | | 20,170.95 |
| 应付利润 | | — |
| 递延所得税负债 | | — |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 140,000.02 |
| 负债合计 | | 59,307,718.40 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 219,313,108.66 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -2,167,286.77 |
| 所有者权益合计 | | 217,145,821.89 |
| 负债和所有者权益总计 | | 276,453,540.29 |

7.2 利润表

会计主体：江信祺福债券型证券投资基金

本报告期：2016年07月27日至2016年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 |
|-------------------|----------|-------------------------|
| | | 2016年07月27日至2016年12月31日 |
| 一、收入 | | -1,061,838.77 |
| 1. 利息收入 | | 4,038,902.02 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 41,696.28 |
| 债券利息收入 | | 3,715,273.60 |
| 资产支持证券利息收入 | | — |
| 买入返售金融资产收入 | | 281,932.14 |
| 其他利息收入 | | — |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 931,439.11 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 372,257.00 |
| 基金投资收益 | | — |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 561,032.11 |

| | | |
|----------------------------|----------|----------------------|
| 资产支持证券投资收益 | | — |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | — |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | -1,850.00 |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | — |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 7.4.7.17 | -6,033,337.26 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | — |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 7.4.7.18 | 1,157.36 |
| 减：二、费用 | | 1,101,618.23 |
| 1. 管理人报酬 | | 478,398.38 |
| 2. 托管费 | | 143,519.53 |
| 3. 销售服务费 | | 38,479.26 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 29,546.19 |
| 5. 利息支出 | | 267,524.87 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 267,524.87 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.20 | 144,150.00 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | -2,163,457.00 |
| 减：所得税费用 | | — |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | -2,163,457.00 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：江信祺福债券型证券投资基金

本报告期：2016年07月27日至2016年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|----|-------------------------|-------|---------|
| | 2016年07月27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） | 223,892,645.85 | — | 223,892,645.85 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | -2,163,457.00 | -2,163,457.00 |
| 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） | -4,579,537.19 | -3,829.77 | -4,583,366.96 |
| 其中：1. 基金申购款 | 12,415,571.32 | 170,831.17 | 12,586,402.49 |
| 2. 基金赎回款 | -16,995,108.51 | -174,660.94 | -17,169,769.45 |
| 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） | 219,313,108.66 | -2,167,286.77 | 217,145,821.89 |

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

江信祺福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[2016]798号文《关于准予江信祺福债券型证券投资基金注册的批复》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《江信祺福债券型证券投资基金基金合同》负责在2016年6月20日至2016年7月21日公开募集。

本基金根据认购/申购费用、销售服务收取方式的不同,将基金份额分级。其中在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额,其基金代码为002723,基金简称为“江信祺福A”;在投资者认购/申购时不收取认/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额,其基金代码为002724,基金简称为“江信祺福C”。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集,江信祺福A不包括认购资金利

息共募集201,153,452.53元,江信祺福C不包括认购资金利息共募集22,725,783.10元,合计223,879,235.63元,已经大华会计师事务所(特殊普通合伙)大华验字[2016]000752号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《江信祺福债券型证券投资基金基金合同》于2016年7月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为223,892,645.85份基金份额,其中认购资金利息折合13,410.22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。

本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款,定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股票(包括中小板,创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、股指期货、国债期货、权证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(须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资权益类资产(包括股票、权证等)比例不高于基金资产的20%,在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资权益类资产(包括股票、权证等)比例不高于基金资产的20%,在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数 \times 20%+中债全债指数 \times 80%。如果今后法律法规发生变化,或指数编制机构调整或停止该等指数的发布,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,基金管理人可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

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》、《江信祺福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7月27日（基金合同生效日）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7月27日（基金合同生效日）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7月27日（基金合同生效日）至2016年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

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。除此以外，金融资产和

金融负债在资产负债表内分别列示, 不予相互抵销。

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。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

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、托管费和销售服务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。

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。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提, 若合同利率与实际利率差异较小, 则采用合同利率计算确定利息支出。

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

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。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。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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 外币交易

无。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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股票及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) 在交易所上市的有价证券（包括股票、可转换债券、权证等），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》，以收盘价估值，上市债券以收盘净价估值，期货合约以结算价格估值。交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。本基金以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价

（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值

净价；交易所上市不存在活跃市场的有价证券（包括资产支持债券等），采用估值技术确定公允价值。如基金管理人认为成本能够近似体现公允价值，基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

（2）在交易所发行的未上市品种，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》，首次发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按交易所上市的同一股票的市价估值；首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按本文附件确定公允价值。本基金分为以下几类进行估值：

- 1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；
- 2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；
- 3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
- 4) 已经发行未上市期间的债券按以下原则处理：①交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。②对银行间市场未上市，且第三方未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用成本估值。③分离交易可转债，上市日前，按未上市有价证券估值原则分别对债券和获配的权证进行估值；自上市日起，债券和获配的权证按上市有价证券估值原则进行估值。

（3）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，暂不缴纳企业所得税。
- (3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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7月27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 |
| 广东国盛金控集团股份有限公司 | 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（2016年7月27日（基金合同生效日）至2016年12月31日），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（2016年7月27日（基金合同生效日）至2016年12月31日），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（2016年7月27日（基金合同生效日）至2016年12月31日），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07月27日至2016年12月31日 | |
|-----------------|-------------------------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 478,398.38 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 578.67 | |

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%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：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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07月27日至2016年12月31日 | |
|----|-------------------------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的托管费 | 143,519.53 |

注：基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.15%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：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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07月27日至2016年12月31日 | | |
|----------------|-------------------------------|-----------|-----------|
| | 江信祺福A | 江信祺福C | 合计 |
| 国盛证券有限责任公司 | — | 37,630.45 | 37,630.45 |
| 中国光大银行股份有限公司 | — | 177.63 | 177.63 |

| | | | |
|------------|---|----------|----------|
| 江信基金管理有限公司 | — | 356.69 | 356.69 |
| 合计 | — | 38164.77 | 38164.77 |

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

本期（2016年7月27日（基金合同生效日）至2016年12月31日），本基金未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

报告期内（2016年7月27日（基金合同生效日）至2016年12月31日），本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

报告期末（2016年12月31日），除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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07月27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 | 2,351,654.81 | 23,105.55 |

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

本期（2016年7月27日（基金合同生效日）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（2016年7月27日（基金合同生效日）至2016年12月31日），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

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 |
| 603035 | 常汽申购 | 2016-12-26 | 2017-01-05 | 新股未上市 | 10.44 | 10.44 | 1,000 | 10,440.00 | 10,440.00 |

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|--------|------|------------|------------|--------|------------|--------|--------|------------|------------|
| 603308 | 应流股份 | 2016-11-24 | 重大资产重组 | 21.92 | 2017-02-14 | 22.46 | 20,000 | 424,150.00 | 438,400.00 |
| 600859 | 王府井 | 2016-12-12 | 重大资产重组 | 16.28 | | | 15,000 | 253,600.00 | 244,200.00 |
| 601518 | 吉林高速 | 2016-12-29 | 终止发行股份购买资产 | 4.27 | 2017-01-05 | 4.70 | 60,000 | 247,800.00 | 256,200.00 |

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30,077,754.88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 |
|--------|--------|------------|--------|---------|---------------|
| 150221 | 15国开21 | 2017-01-05 | 99.03 | 111,000 | 10,992,330.00 |
| 160207 | 16国开07 | 2017-01-05 | 97.02 | 200,000 | 19,404,000.00 |

| | | | | | |
|----|--|--|--|---------|---------------|
| 合计 | | | | 311,000 | 30,396,330.00 |
|----|--|--|--|---------|---------------|

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27,722,000.00元,分别于2017年1月3日、和2017年2月3日到期。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11,470,234.00元,属于第二层级的余额为254,154,760.00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 | 11,470,234.00 | 4.15 |
| | 其中：股票 | 11,470,234.00 | 4.15 |
| 2 | 固定收益投资 | 254,154,760.00 | 91.93 |
| | 其中：债券 | 254,154,760.00 | 91.93 |
| | 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 | 4,446,348.04 | 1.61 |
| 7 | 其他各项资产 | 6,382,198.25 | 2.31 |
| 8 | 合计 | 276,453,540.29 | 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,670,400.00 | 0.77 |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 6,445,840.00 | 2.97 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 328,500.00 | 0.15 |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | 446,600.00 | 0.21 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 908,200.00 | 0.42 |
| H | 住宿和餐饮业 | 141,394.00 | 0.07 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,377,300.00 | 0.63 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|------|
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | 152,000.00 | 0.07 |
| 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 | 11,470,234.00 | 5.28 |

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

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 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601118 | 海南橡胶 | 240,000 | 1,670,400.00 | 0.77 |
| 2 | 600160 | 巨化股份 | 140,000 | 1,481,200.00 | 0.68 |
| 3 | 600637 | 东方明珠 | 50,000 | 1,165,000.00 | 0.54 |
| 4 | 601567 | 三星医疗 | 80,000 | 918,400.00 | 0.42 |
| 5 | 600221 | 海南航空 | 200,000 | 652,000.00 | 0.30 |
| 6 | 002170 | 芭田股份 | 70,000 | 650,300.00 | 0.30 |
| 7 | 000801 | 四川九洲 | 60,000 | 637,800.00 | 0.29 |
| 8 | 600429 | 三元股份 | 80,000 | 628,000.00 | 0.29 |
| 9 | 002017 | 东信和平 | 30,000 | 473,400.00 | 0.22 |
| 10 | 603308 | 应流股份 | 20,000 | 438,400.00 | 0.20 |
| 11 | 002568 | 百润股份 | 20,000 | 404,800.00 | 0.19 |
| 12 | 000875 | 吉电股份 | 50,000 | 328,500.00 | 0.15 |
| 13 | 600085 | 同仁堂 | 10,000 | 313,800.00 | 0.14 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 14 | 002494 | 华斯股份 | 20,000 | 276,800.00 | 0.13 |
| 15 | 601518 | 吉林高速 | 60,000 | 256,200.00 | 0.12 |
| 16 | 600859 | 王府井 | 15,000 | 244,200.00 | 0.11 |
| 17 | 600195 | 中牧股份 | 10,000 | 212,500.00 | 0.10 |
| 18 | 000555 | 神州信息 | 10,000 | 212,300.00 | 0.10 |
| 19 | 600712 | 南宁百货 | 20,000 | 202,400.00 | 0.09 |
| 20 | 002285 | 世联行 | 20,000 | 152,000.00 | 0.07 |
| 21 | 002186 | 全聚德 | 6,427 | 141,394.00 | 0.07 |
| 22 | 603035 | 常熟汽饰 | 1,000 | 10,440.00 | — |

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 | 601118 | 海南橡胶 | 1,925,000.00 | 0.89 |
| 2 | 600160 | 巨化股份 | 1,555,500.00 | 0.72 |
| 3 | 600637 | 东方明珠 | 1,235,200.00 | 0.57 |
| 4 | 601567 | 三星医疗 | 999,852.44 | 0.46 |
| 5 | 000726 | 鲁泰A | 941,955.08 | 0.43 |
| 6 | 600429 | 三元股份 | 891,316.00 | 0.41 |
| 7 | 002170 | 芭田股份 | 702,300.00 | 0.32 |
| 8 | 000801 | 四川九洲 | 686,400.00 | 0.32 |
| 9 | 300421 | 力星股份 | 678,336.00 | 0.31 |
| 10 | 600221 | 海南航空 | 662,000.00 | 0.30 |
| 11 | 300351 | 永贵电器 | 582,000.00 | 0.27 |
| 12 | 002454 | 松芝股份 | 553,982.00 | 0.26 |
| 13 | 002339 | 积成电子 | 518,200.00 | 0.24 |
| 14 | 002142 | 宁波银行 | 490,700.00 | 0.23 |
| 15 | 002494 | 华斯股份 | 487,603.00 | 0.22 |
| 16 | 002568 | 百润股份 | 475,758.00 | 0.22 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 17 | 002017 | 东信和平 | 459,450.00 | 0.21 |
| 18 | 603308 | 应流股份 | 424,150.00 | 0.20 |
| 19 | 601928 | 凤凰传媒 | 338,300.00 | 0.16 |
| 20 | 000875 | 吉电股份 | 337,500.00 | 0.16 |

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 | 000726 | 鲁泰A | 1,007,319.60 | 0.46 |
| 2 | 300421 | 力星股份 | 854,210.00 | 0.39 |
| 3 | 002339 | 积成电子 | 585,600.00 | 0.27 |
| 4 | 002454 | 松芝股份 | 540,057.00 | 0.25 |
| 5 | 300351 | 永贵电器 | 539,004.00 | 0.25 |
| 6 | 002142 | 宁波银行 | 508,000.00 | 0.23 |
| 7 | 601118 | 海南橡胶 | 361,000.00 | 0.17 |
| 8 | 601928 | 凤凰传媒 | 346,500.00 | 0.16 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 342,400.00 | 0.16 |
| 10 | 600685 | 中船防务 | 313,600.00 | 0.14 |
| 11 | 600429 | 三元股份 | 255,900.00 | 0.12 |
| 12 | 601211 | 国泰君安 | 182,000.00 | 0.08 |
| 13 | 002494 | 华斯股份 | 174,600.00 | 0.08 |
| 14 | 600845 | 宝信软件 | 117,000.00 | 0.05 |
| 15 | 002186 | 全聚德 | 80,392.50 | 0.04 |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 17,809,351.52 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 6,207,583.10 |

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 | 7,721,000.00 | 3.56 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 68,919,000.00 | 31.74 |
| | 其中：政策性金融债 | 68,919,000.00 | 31.74 |
| 4 | 企业债券 | 118,010,760.00 | 54.35 |
| 5 | 企业短期融资券 | 39,870,000.00 | 18.36 |
| 6 | 中期票据 | 19,634,000.00 | 9.04 |
| 7 | 可转债 | — | — |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 254,154,760.00 | 117.04 |

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 | 150221 | 15国开21 | 500,000 | 49,515,000.00 | 22.80 |
| 2 | 127105 | 15咸荣盛 | 200,000 | 21,378,000.00 | 9.84 |
| 3 | 124771 | 14亳建投 | 200,000 | 21,240,000.00 | 9.78 |
| 4 | 1080071 | 10营口债 | 250,000 | 20,240,000.00 | 9.32 |
| 5 | 041653030 | 16赣建工 CP001 | 200,000 | 20,012,000.00 | 9.22 |

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

本基金本报告期末进行股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末进行股指期货投资。

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

本基金在报告期内进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

报告期内本基金的国债期货套期保值操作采用买入套期保值策略，主要用于满足投资替代需求，在保证投资组合流动性的同时，获取了资本利得及利息收入。报告期内本基金未开展空头套期保值操作。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

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 | 26,989.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 6,355,209.19 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 6,382,198.25 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1 | 603308 | 应流股份 | — | 0.20 | |

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

| 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 |
| 江信祺福A | 257 | 819,347.74 | 209,863,336.18 | 99.67% | 709,033.91 | 0.34% |

| | | | | | | |
|-------|-------|------------|----------------|--------|--------------|---------|
| 江信祺福C | 908 | 9,626.36 | — | — | 8,740,738.57 | 100.00% |
| 合计 | 1,165 | 188,251.60 | 209,863,336.18 | 95.70% | 9,449,772.48 | 4.31% |

注：本基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属各类基金份额，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属各类基金份额的合计数（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 | 江信祺福A | 15,034.03 | 0.000000% |
| | 江信祺福C | 6,827.55 | 0.080000% |
| | 合计 | 21,861.58 | 0.000000% |

注：本基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属各类基金份额，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属各类基金份额的合计数（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 | 江信祺福A | 0~10 |
| | 江信祺福C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放 式基金 | 江信祺福A | 0~10 |
| | 江信祺福C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 江信祺福A | 江信祺福C |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日(2016年07月27日) 基金份额总额 | 201,161,436.75 | 22,731,209.10 |
| 本报告期期初基金份额总额 | — | — |
| 本报告期基金总申购份额 | 9,926,224.14 | 2,489,347.18 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 515,290.80 | 16,479,817.71 |

| | | |
|--------------|----------------|--------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | — | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 210,572,370.09 | 8,740,738.57 |

§ 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 | 占股票成交总额比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 长城证券 | 1 | — | — | — | — | |
| 广发证券 | 1 | 11,864,367.18 | 49.42% | 8,439.05 | 49.42% | |
| 国盛证券 | 1 | — | — | — | — | |
| 民族证券 | 1 | 12,142,127.44 | 50.58% | 8,636.79 | 50.58% | |

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 |
| 长城证券 | — | — | 11,922,000 .00 | 0.46% | — | — |
| 广发证券 | 6,970,434. 09 | 3.62% | 29,535,000 .00 | 1.15% | — | — |
| 国盛证券 | 82,376,044 .00 | 42.76% | 1,018,600, 000.00 | 39.69% | — | — |
| 民族证券 | 103,321,63 4.00 | 53.63% | 1,506,200, 000.00 | 58.69% | — | — |

§ 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