

江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金2016年半年度报告

2016年6月30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：2016年8月29日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.6 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	37
7.7 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	38
7.8 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	38
7.9 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	38
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.13 投资组合报告附注	38
§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3 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	40
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	40
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
10.2 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	41

10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4	基金投资策略的改变	41
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8	其他重大事件	42
§11	影响投资者决策的其他重要信息	44
§12	备查文件目录	44
12.1	备查文件目录	44
12.2	存放地点	44
12.3	查阅方式	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	江信聚福
基金主代码	000583
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6个月, 集中开放一次申购和赎回。
基金合同生效日	2014年5月29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	1,645,279,758.04份
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。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> <p>本基金在封闭期内债券投资策略如下:</p> <p>1、债券类属配置策略</p> <p>根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析, 确定债券类属配置策略, 并根据市场变化及时进行调整, 从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。</p> <p>2、久期管理策略</p>

	<p>根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。</p> <p>3、收益率曲线策略</p> <p>在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。</p> <p>4、信用债券投资策略</p> <p>本基金将主要通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品，获取票息收益。此外，本基金还将通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断，主动采用信用利差投资策略，获取利差收益。</p> <p>5、本基金对可转换公司债券、资产支持债券等特殊固定收益品种，将利用数量模型，对在其进行充分的定价评估的基础上进行投资。</p>
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的6个月期定期存款基准利率（税后）+1.7%。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，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	唐景丽
	联系电话	010-57380962
	电子邮箱	tangjl@jxfund.cn
客户服务电话	400-622-0583	95595
传真	010-57390988	010-63639132

注册地址	北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼2001-A	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼2001-A	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
邮政编码	100086	100033
法定代表人	孙桢磬	唐双宁

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.jxfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	56,055,472.47
本期利润	33,962,723.25
加权平均基金份额本期利润	0.0213
本期加权平均净值利润率	2.01%
本期基金份额净值增长率	2.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	10,348,949.57

期末可供分配基金份额利润	0.0063
期末基金资产净值	1,721,336,613.53
期末基金份额净值	1.0462
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	35.20%

注：1、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。

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、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6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

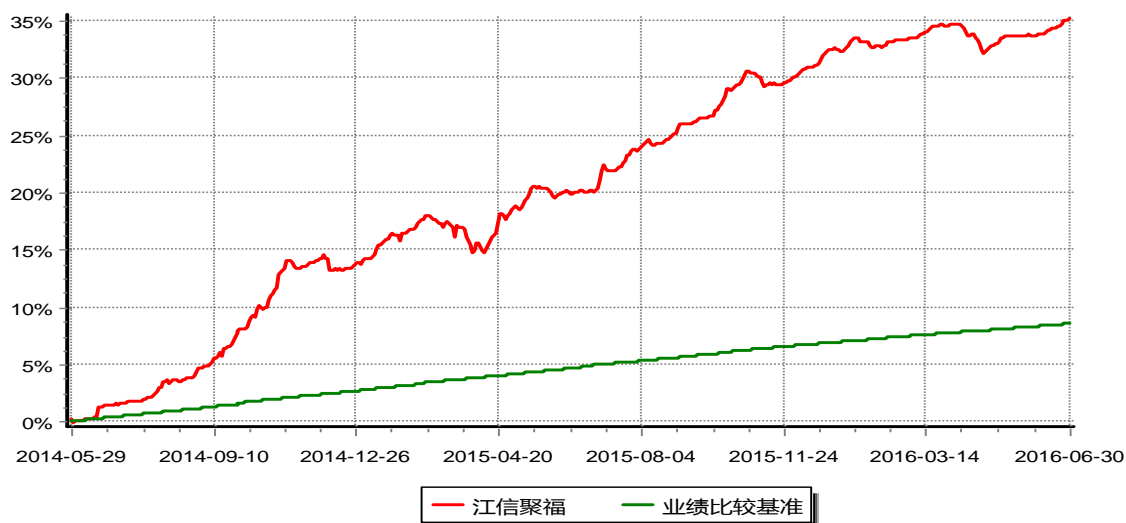
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去一个月	1.09%	0.07%	0.25%	0.01%	0.84%	0.06%
过去三个月	0.43%	0.12%	0.76%	0.01%	-0.33%	0.11%
过去六个月	2.03%	0.11%	1.53%	0.01%	0.50%	0.10%
过去一年	12.51%	0.13%	3.46%	0.01%	9.05%	0.12%
自基金合同生效日起至今（2014年05月29日-2016年06月30日）	35.20%	0.18%	8.56%	0.01%	26.64%	0.17%

### 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





## § 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6月30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。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	2014年5月29日	—	16年	郑昱，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

	资总监				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：这里的任职日期指该基金成立之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在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，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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

报告期内，管理人延续一季度投资策略，维持投资组合适中的杠杆率水平并控制投资组合的久期，均衡配置利率债和高等级信用债。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，本基金份额净值为1.0462元，本报告期份额净值增长率为

2.03%，同期业绩比较基准增长率为1.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度预计收益率将呈震荡走势。目前看房地产及基建投资仍能对经济起到一定托底作用，未来财政政策或将更为积极。货币政策方面，考虑汇率及通胀制约，预计央行仍将维持稳健货币政策，以公开市场和MLF等常规工具为主。短期来看，在市场信用利差和期限利差处于低位情况下，市场波动性将加大，从长期角度看全球经济缺乏经济增长动力，宽松仍是主基调，中国经济转型之路漫长，货币政策易松难紧，利率中枢也将逐步下移。未来操作方面，管理人控制投资组合杠杆水平，提升资产流动性，对低位的信用利差保持谨慎，重点配置高等级信用债并择机对利率债进行波段操作。

#### 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，本基金每份基金份额可分配利润超过0.001元时，本基金可进行收益分配，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5月26日进行了2016年度第一次收益分配，每10份基金份额派0.36元。本报告期末，尚存可供分配的利润共10,348,949.57元，滚存至下一期进行分配。

#### 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

截止本报告期末，本基金运作正常，无需预警说明。

### § 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聚福定期开放债券型发起式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，对江信聚福定期开放债券型发起式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

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“江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金2016年半年度报告”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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	65,961.69	9,844,304.00
结算备付金		45,705,888.24	27,892,590.93
存出保证金		37,910.63	40,843.08
交易性金融资产	6.4.7.2	2,488,081,957.50	2,072,116,736.80
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		2,488,081,957.50	2,072,116,736.80
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		27,017.90	—
应收利息	6.4.7.5	57,068,781.49	45,274,025.10
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		2,590,987,517.45	2,155,168,499.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		868,099,730.00	463,400,000.00
应付证券清算款		—	9,762,367.41
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		845,372.26	788,604.43
应付托管费		281,790.73	262,868.14
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	4,170.00	7,465.00
应交税费		—	—
应付利息		330,333.33	24,767.50
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	89,507.60	180,000.00
负债合计		869,650,903.92	474,426,072.48
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,645,279,758.04	1,583,813,079.20
未分配利润	6.4.7.10	76,056,855.49	96,929,348.23
所有者权益合计		1,721,336,613.53	1,680,742,427.43
负债和所有者权益总计		2,590,987,517.45	2,155,168,499.91

## 6.2 利润表

会计主体：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入		49,256,915.16	67,562,008.89
1. 利息收入		59,117,000.54	45,401,933.42

其中：存款利息收入	6.4.7.11	289,621.37	304,425.50
债券利息收入		58,827,379.17	45,096,009.08
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	1,498.84
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,230,792.12	19,780,947.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	12,230,792.12	19,780,947.54
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—	—
股利收益	6.4.7.16	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-22,092,749.22	2,362,606.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,871.72	16,521.78
<b>减：二、费用</b>		15,294,191.91	17,172,312.39
1. 管理人报酬		5,058,218.55	2,790,623.27
2. 托管费		1,686,072.82	930,207.76
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.19	4,715.94	13,512.38
5. 利息支出		8,424,977.00	13,313,008.83
其中：卖出回购金融资产支出		8,424,977.00	13,313,008.83
6. 其他费用	6.4.7.20	120,207.60	124,960.15

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		33,962,723.25	50,389,696.50
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		33,962,723.25	50,389,696.50

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	1,583,813,079.20	96,929,348.23	1,680,742,427.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	33,962,723.25	33,962,723.25
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)	61,466,678.84	2,182,054.43	63,648,733.27
其中：1. 基金申购款	315,938,338.49	11,286,864.52	327,225,203.01
2. 基金赎回款	-254,471,659.65	-9,104,810.09	-263,576,469.74
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)	—	-57,017,270.42	-57,017,270.42
五、期末所有者权益(基金净值)	1,645,279,758.04	76,056,855.49	1,721,336,613.53
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	879,916,676.85	13,455,096.17	893,371,773.02



二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	50,389,696.50	50,389,696.50
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)	321,013,220.60	4,320,251.27	325,333,471.87
其中：1. 基金申购款	562,319,200.73	6,909,450.97	569,228,651.70
2. 基金赎回款	-241,305,980.13	-2,589,199.70	-243,895,179.83
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)	—	-51,035,167.99	-51,035,167.99
五、期末所有者权益(基金净值)	1,200,929,897.45	17,129,875.95	1,218,059,773.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金(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[2014]242号文《关于核准江信聚福定期开放债券型发起式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《江信聚福定期开放债券型发起式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198,785,738.43元,已经大华会计师事务所(特殊普通合伙)大华验字[2014]000182号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2014年5月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为198,839,914.33份基金份额,其中认购资金利息折合54,175.90份基金份额。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、中小企业私募债、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%，权益类资产占基金资产的比例不超过20%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，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6个月期定期存款基准利率（税后）+1.7%。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。

#### 6.4.2 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》、《江信聚福定期开放债券型发起式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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年1月1日至2016年6月30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6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	65,961.69
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	65,961.69

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	—	—	—

贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	1,008,508,144.90	1,020,532,957.50	12,024,812.60
	银行间市场	1,438,716,950.00	1,467,549,000.00	28,832,050.00
	合计	2,447,225,094.90	2,488,081,957.50	40,856,862.60
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		2,447,225,094.90	2,488,081,957.50	40,856,862.60

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末，本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末，本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	39.31
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	20,567.60
应收债券利息	57,048,157.48
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	17.10

合计	57,068,781.49
----	---------------

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末，本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	4,170.00
合计	4,170.00

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	89,507.60
合计	89,507.60

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,583,813,079.20	1,583,813,079.20
本期申购	315,938,338.49	315,938,338.49
本期赎回（以“-”号填列）	-254,471,659.65	-254,471,659.65
本期末	1,645,279,758.04	1,645,279,758.04

注：申购含红利再投份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,241,043.26	85,688,304.97	96,929,348.23
本期利润	56,055,472.47	-22,092,749.22	33,962,723.25
本期基金份额交易产生的变动数	69,704.26	2,112,350.17	2,182,054.43
其中：基金申购款	996,138.85	10,290,725.67	11,286,864.52
基金赎回款	-926,434.59	-8,178,375.50	-9,104,810.09
本期已分配利润	-57,017,270.42	—	-57,017,270.42
本期末	10,348,949.57	65,707,905.92	76,056,855.49

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	45,648.70
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	243,705.92
其他	266.75
合计	289,621.37

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本报告期内，本基金无股票投资收益。

## 6.4.7.12 基金投资收益

本报告期内，本基金无基金投资收益。

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	12,230,792.12
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—
合计	12,230,792.12

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	347,268,390.67
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	328,080,057.88
减：应收利息总额	6,957,540.67
买卖债券差价收入	12,230,792.12

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期内，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期内，本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内，本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	—

本报告期内，本基金无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-22,092,749.22
——股票投资	—
——债券投资	-22,092,749.22
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	-22,092,749.22

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,871.72
合计	1,871.72

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元



项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	415.94
银行间市场交易费用	4,300.00
合计	4,715.94

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	49,726.04
帐户维护费	18,200.00
跨市场转托管手续费	12,500.00
合计	120,207.60

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截止资产负债表日，本基金无重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

无。

##### 6.4.9.2 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
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	基金发起人、基金管理人、基金注册登记机构、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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,058,218.55	2,790,623.27
其中：支付销售机构的客户维护费	61,730.12	56,102.06

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%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。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	1,686,072.82	930,207.76

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。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内，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。

## 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.4.1 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 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
期初持有的基金份额	10,002,150.00	10,002,150.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,002,150.00	10,002,150.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.6079%	0.83%

## 6.4.10.4.2 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6月30日	上年度末 2015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	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	120,026,000.0 0	7.2952%	120,026,000.0 0	7.58%
中江国际信托 股份有限公司	34,642,227.67	2.1056%	34,642,227.67	2.19%

## 6.4.10.5 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1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行 股份有限公司	65,961.69	45,648.70	—	—
中国光大银行 活期存款	—	—	442,305.61	36,527.91

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。

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	利润分 配 合计	备注
1	2016-05 -26	2016 -5-2 6(场)	2016 -5-2 6(场)	0.360	56,139, 415.33	877,855.09	57,017, 270.42	

		内)	外)					
合计				0.360	56,139, 415.33	877,855.09	57,017, 270.42	

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30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99,999,730.00元，于2016年7月4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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30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768,100,000.00元，于2016年7月1日、2016年7月4日、2016年7月5日、2016年7月6日、2016年7月7日先后到期。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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人风险管理组织体系由三级构成：第一级次为董事会层面的合规与风险管理委员会、督察长；第二级次为经营层面的总经理、风险控制委员会、风控稽核总部；第三级次为公司各业务部门对各自部门的风险控制负责。

本基金的基金管理人主要采取定量和定性相结合的方法。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制信用风险。通过内部信用评级制度，结合外部信用评级，进行信用风险管理；根据交易对手的资质、交易记录、信用记录和交收违约记录等因素对交易对手进行信用评级。

于2016年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为79.18%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	152,880,957.50	145,693,736.80
AAA以下	1,209,999,000.00	1,185,724,000.00
未评级	—	—
合计	1,362,879,957.50	1,331,417,736.80

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一是在某种情况下因市场交易量不足，某些投资品种的流动性不佳，可能导致证券不能迅速、低成本地转变为现金，进而影响到基金投资收益的实现；二是在本基金的开放期内投资人的连续大量赎回将会导致基金的现金支付出现困难，或迫使基金以不适当的价格大量抛

售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。

本基金的基金管理人在开放期内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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2016年6月30日，除6.4.12.3.1中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是由于市场条件(包括但不限于利率、汇率、股票价格和商品价格等因素)发生不利变化，给公司或客户投资带来损失的风险。其中利率水平的变动，将直接影响到基金拟投资债券、利率及债券衍生品等投资品种的价格波动，进而影响基金的收益水平。股票、商品的市场价格变化，将直接作用于股票及股票衍生金融工具、商品及商品衍生工具的市场价格。而当所投资基金在持有的资产组合或金融工具暴露于某外汇币种的情形下，将会可能受到外汇价格变化导致的折价损失，即汇率风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	65,961.69	—	—	—	65,961.69
结算备付金	45,705,888.24	—	—	—	45,705,888.24
存出保证金	37,910.63	—	—	—	37,910.63
交易性金融资产	183,074,957.50	834,112,000.00	1,470,895,000.00	—	2,488,081,957.50
应收证券清算款	—	—	—	27,017.90	27,017.90
应收利息	—	—	—	57,068,781.49	57,068,781.49
资产总计	228,884,718.06	834,112,000.00	1,470,895,000.00	57,095,799.39	2,590,987,517.45
负债					
卖出回购金融资产款	868,099,730.00	—	—	—	868,099,730.00
应付管理人报酬	—	—	—	845,372.26	845,372.26
应付托管费	—	—	—	281,790.73	281,790.73
应付交易费用	—	—	—	4,170.00	4,170.00
应付利息	—	—	—	330,333.33	330,333.33
其他负债	—	—	—	89,507.60	89,507.60
负债总计	868,099,730.00	—	—	1,551,173.92	869,650,903.92
利率敏感度缺口	-639,215,011.94	834,112,000.00	1,470,895,000.00	55,544,625.47	1,721,336,613.53



上年度末 2015年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,844,304.00	—	—	—	9,844,304.00
结算备付金	27,892,590.93	—	—	—	27,892,590.93
存出保证金	40,843.08	—	—	—	40,843.08
交易性金融资产	36,518,736.80	630,899,000.00	1,404,699,000.00	—	2,072,116,736.80
应收利息	—	—	—	45,274,025.10	45,274,025.10
资产总计	74,296,474.81	630,899,000.00	1,404,699,000.00	45,274,025.10	2,155,168,499.91
负债					
卖出回购金融资产款	463,400,000.00	—	—	—	463,400,000.00
应付证券清算款	—	—	—	9,762,367.41	9,762,367.41
应付管理人报酬	—	—	—	788,604.43	788,604.43
应付托管费	—	—	—	262,868.14	262,868.14
应付交易费用	—	—	—	7,465.00	7,465.00
应付利息	—	—	—	24,767.50	24,767.50
其他负债	—	—	—	180,000.00	180,000.00
负债总计	463,400,000.00	—	—	11,026,072.48	474,426,072.48
利率敏感度缺口	-389,103,525.19	630,899,000.00	1,404,699,000.00	34,247,952.62	1,680,742,427.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点		
假设	2. 其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	2. 市场利率下降25个基点	24,887,281.62	22,817,871.52
	1. 市场利率上升25个基点	-24,485,365.06	-22,422,934.85

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资决策，采取债券类属配置策略、久期管理策略、收益率曲线策略、信用债券投资策略和特殊固定收益品种投资策略。

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%，权益类资产占基金资产的比例不超过20%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，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）。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本期末，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 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6月30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43,890,957.50元，属于第二层级的余额为2,444,191,000.00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。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	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	2,488,081,957.50	96.03
	其中：债券	2,488,081,957.50	96.03
	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	45,771,849.93	1.77
7	其他各项资产	57,133,710.02	2.21
8	合计	2,590,987,517.45	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本期末，本基金未持有股票。

### 7.3 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，本基金未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

本期末，本基金未持有股票。

#### 7.4.2 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	—
卖出股票的收入（成交）总额	—

注：本期末，本基金未持有股票。

#### 7.5 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	774,475,000.00	44.99
2	央行票据	—	—
3	金融债券	350,727,000.00	20.38
	其中：政策性金融债	350,727,000.00	20.38
4	企业债券	1,063,589,000.00	61.79
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	153,800,000.00	8.93
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	145,490,957.50	8.45
10	合计	2,488,081,957.50	144.54

#### 7.6 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	019523	15国债23	1,500,000	151,215,000.00	8.78
2	140205	14国开05	1,000,000	116,670,000.00	6.78
3	019421	14国债21	1,000,000	108,770,000.00	6.32

				0	
4	1580059	15九江置地债	1,000,000	106,440,000.00	6.18
5	1580052	15泗洪债	1,000,000	106,080,000.00	6.16

#### 7.7 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，本基金未持有资产支持证券。

#### 7.8 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，本基金未持有贵金属。

#### 7.9 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，本基金未持有权证。

#### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本期末，本基金未持有基金。

#### 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本期末，本基金未持有股指期货。

##### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本期末，本基金未持有股指期货。

#### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.12.1 本期国债期货投资政策

本期末，本基金未持有国债期货。

##### 7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本期末，本基金未持有国债期货。

##### 7.12.3 本期国债期货投资评价

本期末，本基金未持有国债期货。

#### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 本期末，本基金未持有股票。

### 7.13.3 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	37,910.63
2	应收证券清算款	27,017.90
3	应收股利	—
4	应收利息	57,068,781.49
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	57,133,710.02

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本期末，本基金未持有股票。

### 7.13.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
3,154	521,648.62	1,493,169,853 .53	90.7548 %	152,109,904.5 1	9.2452%

## 8.2 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	935,958.46	0.0569%

## 8.3 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份 额占基 金总份 额比例	发起份额总 数	发起份额占 基金总份 额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	10,002,150. 00	0.6079 %	10,002,150. 00	0.6079%	3年
基金管理人高级管 理人员	290,455.74	0.0177 %	249,695.17	0.0152%	3年
基金经理等人员	333,933.53	0.0203 %	228,744.10	0.0139%	3年
基金管理人股东	120,026,000 .00	7.2952 %	120,026,000 .00	7.2952%	3年
其他	—	—	—	—	
合计	130,652,539	7.9411	130,506,589	7.9322%	



	.27	%	.27		
--	-----	---	-----	--	--

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年5月29日)基金份额总额	198,839,914.33
本报告期期初基金份额总额	1,583,813,079.20
本报告期基金总申购份额	315,938,338.49
减：本报告期基金总赎回份额	254,471,659.65
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,645,279,758.04

注：申购含红利再投份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本报告期内，无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所为大华会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变动。

### 10.6 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 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	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国盛证券	1	—	—	—	—	—

## 10.7.2 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	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
国盛证券	437,991,577.8	100%	36,535,200,000	100%	—	—

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书更新(2016年第1号)	证券日报、公司官网	2016-01-12
2	江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金2015年第4季度报告	证券日报、公司官网	2016-01-21
3	江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金2015年年度报告及其摘要	证券日报、公司官网	2016-03-29
4	江信基金管理有限公司关于江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金增加代销机构的公告	证券日报、公司官网	2016-03-29
5	江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金2016年第1季度报	证券日报、公司官网	2016-04-20

	告		
6	江信基金管理有限公司关于旗下开放式证券投资基金增加代销机构的公告	证券日报、公司官网	2016-05-18
7	江信基金管理有限公司关于调整旗下开放式证券投资基金赎回份额下限的公告	证券日报、公司官网	2016-05-19
8	江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回的业务公告	证券日报、公司官网	2016-05-19
9	江信基金管理有限公司关于江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金增加日发资产管理（上海）有限公司为代销机构的公告	证券日报、公司官网	2016-05-19
10	江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金2016年第一次分红公告	证券日报、公司官网	2016-05-25
11	江信基金管理有限公司关于旗下开放式证券投资基金增加代销机构的公告	证券日报、公司官网	2016-05-25
12	江信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	证券日报、公司官网	2016-06-08
13	江信基金管理有限公司关于董事、监事变更的公告	证券日报、公司官网	2016-06-09
14	江信基金管理有限公司关于旗下开放式证券投资基金参加国盛证券有限责任公司开展的申购费率优惠活动的公告	证券日报、公司官网	2016-06-17
15	江信基金管理有限公司关于旗下开放式证券投资基金增加代销机构的公告	证券日报、公司官网	2016-06-25
16	江信基金管理有限公司关于旗下	证券日报、公司官网	2016-06-30

	开放式证券投资基金增加代销机构的公告		
--	--------------------	--	--

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、江信基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

#### 12.2 存放地点

存放在本基金管理人的办公场所

#### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

江信基金管理有限公司

二〇一六年八月二十九日