

基金代码：001675      基金简称：江信同福 A

基金代码：001676      基金简称：江信同福 C

**江信同福灵活配置混合型  
证券投资基金招募说明书摘要（更新）  
（2016 年第 2 号）**

**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**

二〇一六年十月

## 一、重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会 2015 年 07 月 02 日证监许可[2015]1496 号文准予注册募集，本基金基金合同于 2015 年 8 月 28 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金份额价格存在波动，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并自行承担投资风险。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等。本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

投资有风险，投资者在申购本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。基金管理

人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金资产净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 8 月 29 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日。（财务数据未经审计）

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

名称：江信基金管理有限公司

住所：北京市海淀区北三环西路 99 号西海国际中心 1 号楼 2001-A

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

法定代表人：孙桢磬

成立日期：2013 年 1 月 28 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2012]1717 号

经营范围：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

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿捌仟万元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：400-622-0583

江信基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2012]1717 号文批准，由国盛证券有限公司、恒生阳光集团有限公司、中炬高新技术实业（集团）股份有限公司共同发起设立。2013 年 9 月 30 日，经中国证监会证监许可[2013]1270 号文批准进行了股权变更。2015 年 7 月 15 日，经中国证监会证监许可[2015]1667 号文批准增加注册资本并进行股权变更，目前股权结构为：

序号	股东名称	持股比例
1	国盛证券有限责任公司	30%
2	恒生阳光集团有限公司	17.5%
3	金麒麟投资有限公司	17.5%
4	鹰潭聚福投资管理有限合伙企业	17.5%
5	鹰潭红石投资管理有限合伙企业	17.5%
合计		100%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基

金资产的投资运作。

公司日常经营由总经理负责。公司根据经营运作需要设置行政管理总部、风控稽核总部、运营保障总部、市场开发总部、专户投资总部、投资管理总部、研究发展部、证券交易部共八个职能部门。

基金管理情况：目前基金管理人旗下管理四只基金，分别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。

## （二）主要人员情况

孙桢礪先生，董事，中共党员，硕士，毕业于江西财经大学。历任江南证券宜春营业部、天津营业部交易部经理、副总经理，国盛证券有限责任公司南昌八一大道证券营业部总经理、人力资源总部部长、副总监，江信基金管理有限公司筹备组组长等职务。现任江信基金管理有限公司董事长。

曾海先生，董事，中共党员，高级会计师，学士，毕业于江西财经大学。历任江西省木材公司财务科长，江西国际信托股份有限公司财务处长、财务总监。现任中江国际信托股份有限公司副总裁。

朱宇先生，董事，中共党员，硕士，毕业于江西财经大学。历任江西国际信托股份有限公司信托经理、办公室主任、董秘、战略管理部部长，国盛证券有限责任公司董秘兼行政部部长。现任国盛证券有限责任公司董事会秘书兼副总裁。

李静女士，董事，硕士，毕业于新疆大学。历任新疆众联亨投资管理有限公司法务经理、新疆直通律师事务所律师、新疆汇民融通资产管理有限公司法务经理。现任恒生阳光集团有限公司法务。

马亮先生，董事，中共党员，学士，毕业于中共中央党校函授学院。曾在武警上饶地区支队服兵役，曾任江西深国投商用置业发展有限公司总经理。现任金麒麟投资有限公司副总经理。

初英先生，董事，硕士，毕业于中国石油大学。历任中国石油大学网络中心系统管理员、数动信息技术（中国）有限公司技术总监、世纪互联信息电讯股份有限公司总经理助理、国盛证券有限责任公司投资管理总部、

江信基金管理有限公司筹备组副组长。现任江信基金管理有限公司总经理。

李克诚先生，独立董事，博士、教授，毕业于北京工业大学与瑞士维多利亚大学。曾任北京焦化厂干部、中国民主建国会中央委员会干部。现任北京大学中国精算发展研究中心常务副主任。

杨帆先生，独立董事，中共党员，博士、教授，毕业于中国社会科学院经济研究所。历任北京西城区机床厂工人，天津开发区研究所所长、国家物价局副处长，中国社会科学院经济研究所副研究院。现任中国政法大学教授。

刘会生先生，独立董事，中共党员，硕士，一级高级法官，毕业于北京大学。曾服兵役，曾任最高人民法院办公厅主任。现任北京市地平线律师事务所主任。

## 2、监事

丁星元女士，职工监事，学士，毕业于哈尔滨工业大学。曾先后在国盛证券有限责任公司固定收益总部、中江国际信托股份有限公司行政部工作。现任江信基金管理有限公司行政管理总部总监。

钱考先生，监事，学士，毕业于江西农业大学计算机与科学技术专业；曾先后在国盛证券有限责任公司运营保障总部、中江国际信托股份有限公司托管部工作。现任江信基金运营保障总部信息技术部副总经理。

## 3、高级管理人员

孙桢礪先生，董事长, 董事。简历同上。

初英先生，总经理，董事。简历同上。

严命有先生，中共党员，硕士，毕业于华东交通大学。历任中江国际信托股份有限公司财务部部长、财务总监，国盛证券有限责任公司财务总监助理，天安财险股份有限公司总裁助理兼财务负责人。现任江信基金管理有限公司督察长。

## 4、督察长

严命有先生，督察长。简历同上。

## 5、基金经理

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，并担任以下基金的基金经理：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。

王安良先生，MBA 硕士，15 年证券从业经历，曾就职于江西省国有资产管理局担任资产评估处干部、2001 年 2 月至 2002 年 12 月在江西省发展信托股份有限公司担任证券部经理、2002 年 12 月至 2009 年 9 月国盛证券有限责任公司担任财务总部副总经理、2009 年 9 月至 2013 年 1 月在国盛证券有限责任公司担任投资管理总部总经理、2013 年 1 月至 2015 年 3 月在江信基金管理有限公司担任督察长、2015 年 3 月至 10 月在国盛证券有限责任公司担任投资管理总部总经理。2015 年 10 月至今在江信基金管理有限公司担任权益投资总监。自 2016 年 2 月 4 日起担任江信同福灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 6、投资决策委员会成员的姓名及职务

本基金投资采取集体决策制度，投资委员会成员的姓名及职务如下：

公司总经理初英先生，固定收益投资总监郑昱先生，权益投资总监王安良先生，固定收益投资总监助理杨淳先生、固定收益部静鹏先生。

列席人员：

严命有，督察长。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基

金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人



合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### （四）基金管理人的承诺

##### 1、基金管理人承诺

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的活动，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人及其董事、监事、高级管理人员和其他从业人员的禁止性行为

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反《基金合同》或《托管协议》；

(3) 故意损害基金持有人或其它基金相关机构的合法权益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权；

(7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其它股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(11) 贬损同行，以提高自己；

(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其它法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 向基金管理人、基金托管人出资；

(5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制。

#### 5、基金经理承诺：

(1) 依照有关法律、法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是公司经营管理的纲领性文件，是制定各项管理制度及规章的基础和依据。内部控制大纲主要包括内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括风险管理制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

## 2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡。

成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、内部控制组织体系

(1) 股东会是公司的最高权力机构,依照有关法律法规和公司章程行使职权,并承担相应的责任。

(2) 股东会选举董事组成董事会。董事会下设合规与风险管理委员会、薪酬与提名委员会、审计委员会。各专门委员会依照法律法规和公司章程的规定行使职权,对公司的内部控制实行定期和不定期的检查、评价,适时的出具专题报告,并报董事会。

(3) 督察长监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长履行职责的范围涵盖基金及公司运作的所有业务环节。

(4) 风险控制委员会是公司业务经营的风险审查机构,工作具有相对的独立性。风险控制委员会坚持风险可测、可控、可承受的原则,把风险防范放在第一位。

(5) 风控稽核总部独立于公司各业务部门和各分支机构,定期和不定期的对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。

(6) 根据独立性、防火墙以及相互制约的原则，设立满足公司经营必需的机构、部门及岗位。各部门在分工合作的基础上，明确各岗位职权和责任，建立相互配合、相互制约、相互促进的工作关系。通过制定规范的岗位责任制、合理的工作标准和严格的操作程序，使各项工作规范化、程序化、标准化。

#### 4、内部控制制度体系

公司制定合理、完备、有效并易于操作的内部控制制度体系。

内部控制制度体系按照控制制度的效力等级分为四个层面：第一个层面是公司章程，是公司经营管理遵循的最高文件；第二个层面是公司内部控制大纲，是公司制定各项基本管理制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度，是公司日常运作的、有针对性的基础性规范；第四个层面是公司根据基本管理制度制定的更为具体的管理办法和实施细则等。上层制度与下层制度有机联系，前者指导和制约后者，后者体现和细化前者。

公司章程的制定与修改须经股东会审议通过并向监管部门备案。

公司内部控制大纲、基本管理制度的制定与修改由公司总经理或督察长提出议案，经董事会审议通过后实施。

督察长、风控稽核总部对公司制度的执行情况进行日常性的监督和检查，向公司总经理或相关部门提出意见和建议。总经理对该意见和建议进行协调处理，安排相关部门负责落实。督察长、风控稽核总部对落实情况进行跟踪检查。

各部门定期或不定期对涉及本部门的公司制度的执行情况进行自查，发现问题应及时向公司总经理、督察长和风控稽核总部报告，并负责落实相关事项。

在出现新的市场环境、新的金融工具、新的应用技术、新的法律法规等情况，并有可能影响到基金投资、公司运营时，按规定的程序对内部控制制度进行修改和完善。

#### 5、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确。

---

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

设立日期：1992年8月18日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行，银复1992[152]号

组织形式：股份有限公司

注册资本：404.3479亿元人民币

法定代表人：唐双宁

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75号

投资与托管部总经理：曾闻学

托管部门联系人：李宁

电话：(010) 63636363

传真：(010) 63639132

网址：www.cebbank.com

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长、中国人民银行沈阳市分行行长，中国人民银行信贷管理司司长、货币金银局局长、银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会副主席，中国光大（集团）总公司董事长、党委书记等职务。现任十二届全国人大农业与农村委员会副主任，十一届全国政协委员，中国光大集团股份公司董事长、党委书记，中国光大集团有限公司董事长，兼任中国光大银行股份有限公司董事长、党委书记，中国光大控股有限公司董事局主席，中国光大国际有限公司董事局主席。

行长张金良先生，曾任中国银行财会部会计制度处副处长、处长、副总经理兼任 IT 蓝图实施办公室主任、总经理，中国银行北京市分行行长、党委书记，中国银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司党委委员，兼任中国光大银行行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资托管部总经理。

(三) 证券投资基金托管情况：

截至 2016 年 6 月 30 日，中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力股票型证券投资基金、国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金 (LOF)、摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、博时转债增强债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成货币市场基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、泰信先行策略开放式证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金 (LOF)、国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、兴业商业模式优选股票型证券投资基金、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金、中加货币市场基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、泓德优选成长混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、财通多策略精选混合型证券投资基金、鹏华添利宝货币市场基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、易方达瑞选灵活配置混



合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、南方弘利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元兴利债券型证券投资基金、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、中欧强盈定期开放债券型证券投资基金、华夏恒利 6 个月定期开放债券型证券投资基金、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金、博时安怡 6 个月定期开放债券型证券投资基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、鹏华兴华定期开放灵活配置混合型证券投资基金共 64 只证券投资基金，托管基金资产规模 1,381.42 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### (1) 直销机构

本基金直销机构为基金管理人的直销中心以及基金管理人的网上交易平台。

##### 1) 江信基金管理有限公司直销中心

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

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

法定代表人:孙桢礪

成立日期:2013 年 1 月 28 日

客服热线:400-622-0583

投资者可以通过基金管理人本公司网上交易系统办理基金的认购、申购、赎回等业务,具体业务办理情况及业务规则请登录基金管理人本公司网站查询。本公司网址 [www.jxfund.cn](http://www.jxfund.cn)。

##### (2) 其他销售机构(排名不分前后)

##### 1) 中国光大银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

办公地址:北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人:唐双宁

客户服务电话:95595

公司网站: [www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

##### 2) 国盛证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

办公地址:江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

法定代表人:曾小普

客户服务电话:4008222111

公司网站: [www.gszq.com](http://www.gszq.com)

3) 长城证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 16-17 层

办公地址：广东省深圳市深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 16-17 层

法定代表人：黄耀华

客户服务电话：400-6666-888

公司网站：www.cgws.com

4) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客户服务电话：95548

公司网站：www.cs.ecitic.com

5) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

公司网站：www.zxwt.com.cn

6) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-9908-826

公司网站：www.citicsf.com

7) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场  
(4301-4316 房)

办公地址：广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5 楼，  
7 楼，18 楼，19 楼，38 楼，39 楼，40-44 楼

法定代表人：孙树明

客户服务电话：95575

公司网站：www.gf.com.cn

8) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳南山区科技中一路华强高新大厦 7-8 楼

办公地址：深圳南山区科技中一路华强高新大厦 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

客户服务电话：4001-022-011

公司网站：www.zszq.com

9) 杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

10) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

11) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 层

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

公司网站：www.1234567.com.cn

12) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

客户服务电话：400-021-8850

公司网站：www.harvestwm.cn

13) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

14) 日发资产管理（上海）有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 66 号 3301 室

办公地址：上海市陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行大厦 3301 室

法定代表人：周泉恭

客户服务电话：021-6160 0500

公司网站：www.rffund.com

15) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

客户服务电话：400-928-2266

公司网站：www.dtfunds.com

16) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

客户服务电话：400-893-6885

公司网站：www.qianjing.com

17) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层

法定代表人：燕斌

客户服务电话：021-52822063

公司网站：www.91fund.com.cn

18) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东大道555号裕景国际B座16楼

法定代表人：张跃伟

客户服务电话： 400-820-2899

公司网站： [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

19) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 14 楼

法定代表人：李兴春

客户服务电话： 400-033-7933

公司网站： [www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

20) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：张彦

客户服务电话： 400-166-1188

公司网站： [www.new-rand.cn](http://www.new-rand.cn)

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

#### (二) 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住址：北京市西城区太平桥大街 17 号

电话：010-58598889

传真：010-58598805

#### (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市高朋律师事务所

住所：北京市朝阳区东三环北路 2 号南银大厦 28 层

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 2 号南银大厦 28 层

负责人：王磊

电话：010-59241188

传真：010-59241199

经办律师：李梅 李小军

联系人： 韩冰

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：大华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京海淀区西四环中路十六号院7号楼12层

办公地址：北京海淀区西四环中路十六号院7号楼12层

执行事务合伙人：李文智

电话：13910887931

传真：010-58350006

经办注册会计师：陈静



## 四、基金的名称

本基金名称：江信同福灵活配置混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

基金的类型：契约型开放式

## 六、基金的投资目标和投资方向

### (一) 投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力争实现基金资产较高的长期稳健回报。

### (二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、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（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票投资占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；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。

## 七、基金的投资策略

本基金的投资策略：

### (1) 资产配置策略

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。

### （2）股票投资策略

在股票投资上本基金主要根据上市公司获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平来进行个股选择。同时，适度把握宏观经济情况进行资产配置。具体来说，本基金通过以下步骤进行股票选择：

首先，通过 ROIC（Return On Invested Capital）指标来衡量公司的获利能力，通过 WACC（Weighted Average Cost of Capital）指标来衡量公司的资本成本；其次，将公司的获利能力和资本成本指标相结合，选择出创造价值的公司；最后，根据公司的成长能力和估值指标，选择股票，构建股票组合。

### （3）普通债券投资策略

在债券投资上，本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券：

- 1) 信用等级高、流动性好；
- 2) 资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；
- 3) 在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券；
- 4) 公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债。

### （4）股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

### （5）国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，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。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### (6) 权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证的投资。

1) 综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素，根据 BS 模型和溢价率对权证的合理价值做出判断，对价值被低估的权证进行投资；

2) 基于对权证标的股票未来走势的预期，充分利用权证的杆杆比率高的特点，对权证进行单边投资；

3) 基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断，将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资，或利用权证进行风险对冲。

#### (7) 资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券 (ABS)、住房抵押贷款支持证券 (MBS) 等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。

本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。

对于监管机构允许基金投资的其他金融工具，本基金将在谨慎分析收益性、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上进行稳健投资，以降低组合风险，实现基金资产的保值增值。

## 八、业绩比较基准

沪深 300 指数×50%+上证国债指数×50%。

沪深 300 指数由专业指数提供商“中证指数有限公司”编制和发布，由从上海和深圳证券交易所中选取的 300 只 A 股作为样本股编制而成。该指数以成份股的可自由流通股数进行加权，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性和市场影响力。

上证国债指数全称为“上海证券交易所国债指数”，是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。其编制方法借鉴了国际成熟市场主流债券指数的编制方法和特点，并充分考虑了国内债券市场发展的现状，具备科学性、合理性、简便性和易于复制等优点。上证国债指数可以表征整个中国国债市场的总体表现。

根据本基金设定的投资范围，基金管理人以 50%的沪深 300 指数和 50%的上证国债指数构建的复合指数作为本基金的业绩比较基准，与本基金的投资风格基本一致，可以用来客观公正地衡量本基金的主动管理收益水平。

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。

## 九、风险收益特征

本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

## 十、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2016 年 月 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2016 年 04 月 01 日起至 2016 年 06 月 30 日止。

### 1 报告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	11,693,348.71	4.35
	其中：股票	11,693,348.71	4.35
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	249,148,122.90	92.77
	其中：债券	249,148,122.90	92.77
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	1,450,323.99	0.54
8	其他资产	6,286,729.28	2.34
9	合计	268,578,524.88	100.00



## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	194,870.07	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,464,000.00	2.77
E	建筑业	105,478.64	0.05
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	5,929,000.00	3.01
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	11,693,348.71	5.93

### 2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

## 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601788	光大证券	350,000	5,929,000.00	3.01
2	601985	中国核电	800,000	5,464,000.00	2.77
3	601611	中国核建	5,042	105,478.64	0.05
4	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
5	601127	小康股份	2,605	62,181.35	0.03
6	601966	玲珑轮胎	1,643	21,326.14	0.01
7	603958	哈森股份	1,455	21,097.50	0.01
8	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01

## 4 报告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	90,879,000.00	46.11
2	央行票据	—	—
3	金融债券	54,310,000.00	27.56
	其中：政策性金融债	54,310,000.00	27.56
4	企业债券	85,705,000.00	43.49
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据		—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	18,254,122.90	9.26
10	合计	249,148,122.90	126.42

## 5 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	130240	13国开40	500,000	54,310,000.00	27.56

2	019523	15国债23	500,000	50,405,000.00	25.58
3	019526	15国债26	300,000	30,528,000.00	15.49
4	132005	15国资EB	169,790	18,254,122.90	9.26
5	1280013	12柳州东城债	200,000	12,866,000.00	6.53

## 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 7 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 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 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。

### 9.2 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。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末进行国债期货投资。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货投资。

### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

## 11 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

### 11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	91,668.12
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	6,190,981.06
5	应收申购款	4,080.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,286,729.28

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.5 报告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	601611	中国核建	105,478.64	0.05	临时停牌
2	601966	玲珑轮胎	21,326.14	0.01	新股申购
3	603016	新宏泰	13,600.98	0.01	新股申购

### 11.6 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。

#### (十一) 基金的业绩

基金业绩截止日为2016年6月30日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基

金的招募说明书。

## 1. 本报告期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

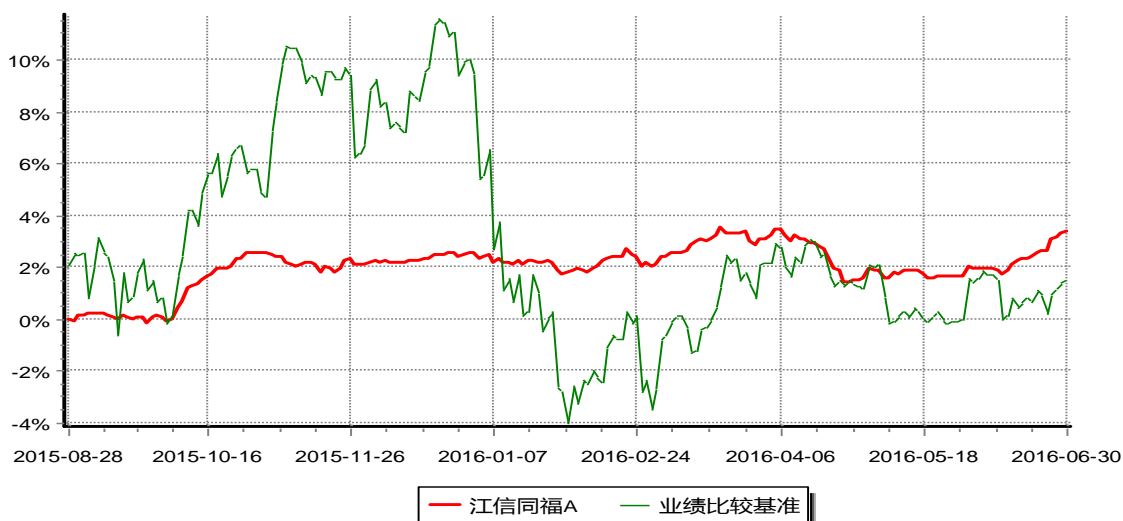
江信同福A

阶段	净值增长率①	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	0.26%	0.17%	-0.64%	0.49%	0.90%	-0.32%

江信同福C

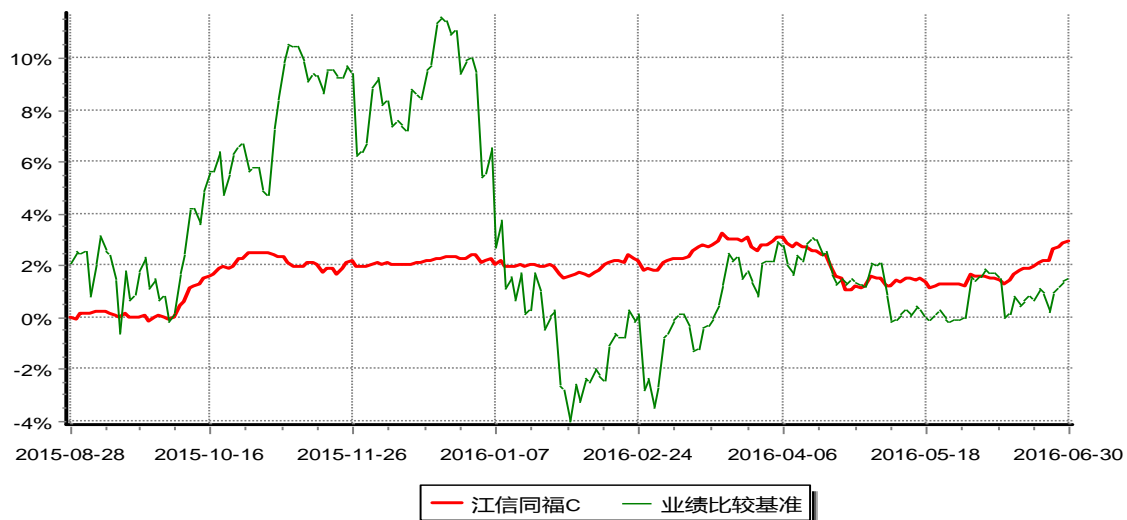
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.12%	0.17%	-0.64%	0.49%	0.76%	-0.32%

## 2. 自基金合同生效以来基金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、图示日期为2015年8月28日至2016年6月30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，股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；在扣除股指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%。



注：1、图示日期为2015年8月28日至2016年6月30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，股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；在扣除股指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%。

## 十一、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日资产净值

基金销售服务费每日计算，逐累至每月月末，按月支付，由管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划付给销售机构。若遇法定节假日、公休等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

4、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于本基金成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

### (三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；



- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十二、对招募说明书更新部分的说明

一、本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，

对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

一、在“重要提示”中，更新了本基金的生效情况及本招募说明书所载内容截止日、有关财务数据截止日和净值表现截止日。

二、在“三、基金管理人”部分，对基金管理人相关内容进行了更新。

三、在“四、基金托管人”部分，对基金托管人的相关内容进行了更新。

四、在“五、相关服务机构”部分，对相关服务机构的相关内容进行了更新。

五、在“九、基金的投资”部分，根据本基金的实际运作情况，更新了最近一期投资组合报告的内容，及最近一期基金的业绩。

六、在“二十二、其他应披露事项”部分中披露了本报告期内本基金及本基金管理公司已刊登的公告内容。

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

江信基金管理有限公司

二〇一六年十月