

江信祺福债券型证券投资基金2017年半年度报告

2017年06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：2017年08月26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2017年8月25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2017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
§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	7
	2.4 信息披露方式	8
	2.5 其他相关资料	8
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
	3.1 主要会计数据和财务指标	8
	3.2 基金净值表现	9
§4	管理人报告	11
	4.1 基金管理人及基金经理情况	11
	4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
	4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
	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	13
	4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
	4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
	4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§5	托管人报告	15
	5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
	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	15
	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	15
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
	6.1 资产负债表	15
	6.2 利润表	17
	6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
	6.4 报表附注	20
§7	投资组合报告	40
	7.1 期末基金资产组合情况	40
	7.2.1 期末按行业分类的股票投资组合	41
	7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	42
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
	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	44
	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	45
	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	45
	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	45
	7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
	7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
	7.12 投资组合报告附注	45
§8	基金份额持有人信息	46
	8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
	8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	47
	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	47
§9	开放式基金份额变动	47
§10	重大事件揭示	48
	10.1 基金份额持有人大会决议	48
	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	48
	10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
	10.4 基金投资策略的改变	48

10.5	基金改聘会计师事务所情况.....	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8	其他重大事件.....	49
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12	备查文件目录.....	51
12.1	备查文件目录.....	51
12.2	存放地点.....	51
12.3	查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	江信祺福债券型证券投资基金	
基金简称	江信祺福	
基金主代码	002723	
交易代码		
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	113,309,951.49	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	江信祺福A	江信祺福C
下属两级基金的交易代码	002723	002724
报告期末下属两级基金的份 额总额	110,268,513.71	3,041,437.78

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	<p>(1) 资产配置策略</p> <p>本基金是债券型基金，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，对债券、股票和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在债券、股票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。</p> <p>(2) 普通债券投资策略</p> <p>在债券投资上，本基金将重点关注具有以下一项或者</p>

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。

(3) 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。具体步骤：

首先，通过ROIC指标来衡量公司的获利能力，通过WACC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。

(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。

(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。

(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

	<p>进行投资；</p> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>(7) 资产支持证券等品种投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	
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。	
下属两级基金的风险收益特征	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。	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

			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
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	100032
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

单位：人民币元

	江信祺福A	江信祺福C

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日-2017年06月30日）	
本期已实现收益	-7,667,275.53	-132,365.67
本期利润	-1,639,219.80	-77,965.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0082	-0.0128
本期基金加权平均净值利润率	-0.83%	-1.30%
本期基金份额净值增长率	-0.50%	-0.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)	
期末可供分配利润	-2,330,160.72	-78,511.43
期末可供分配基金份额利润	-0.0211	-0.0258
期末基金资产净值	108,640,830.75	2,981,959.74
期末基金份额净值	0.9852	0.9804
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.48%	-1.96%

注：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。

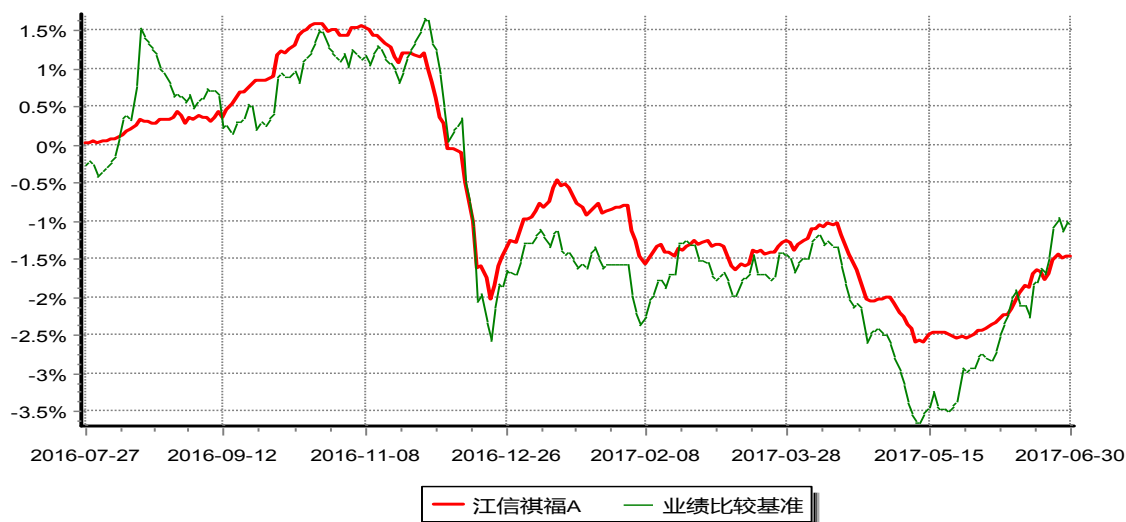
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.98%	0.07%	1.78%	0.17%	-0.80%	-0.10%
过去三个月	-0.17%	0.09%	0.50%	0.17%	-0.67%	-0.08%
过去六个月	-0.50%	0.08%	0.25%	0.16%	-0.75%	-0.08%
自基金合同生效日起至今（2016年07月27日-2017年06月30日）	-1.48%	0.10%	-1.05%	0.19%	-0.43%	-0.09%
阶段 (江信祺福C)	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④

	率①	率标准 差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去一个月	0.92%	0.06%	1.78%	0.17%	-0.86%	-0.11%
过去三个月	-0.33%	0.08%	0.50%	0.17%	-0.83%	-0.09%
过去六个月	-0.78%	0.08%	0.25%	0.16%	-1.03%	-0.08%
自基金合同生效日起 至今（2016年07月27 日-2017年06月30日）	-1.96%	0.10%	-1.05%	0.19%	-0.91%	-0.09%

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、图示日期为2016年07月27日至2017年06月30日。

2、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%。



注：1、图示日期为2016年07月27日至2017年06月30日。

2、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%。

§ 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2017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、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、江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金、江信一年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	说明
----	----	-------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
杨淳	公司固定收益投资总监助理，本基金的基金经理	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、江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金、江信一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。
静鹏	本基金的基金经理	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基金经理、江信洪福纯债债券型证券投资基金基金经理。

注：1、任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

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办法》，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 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、特定客户资产管理计划针对股票、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、特定客户资产管理计划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

2017年2季度，债券市场收益率整体上行。基本面方面，宏观经济延续较

好态势，基建投资快速扩张，房地产和制造业投资稳中有升。受总需求平稳以及企业补库存影响，工业生产持续向好。政策方面，在抑制资产泡沫和防范金融风险背景下，央行继续实施稳健中性的货币政策，资金面多数时间呈现紧平衡状态，资金利率中枢上升，月末季末等关键时点资金价格波动较大。

2季度权益市场整体上涨，不同板块表现分化。受到经济回暖、企业盈利改善影响，盈利能力较强、估值较低的蓝筹板块表现相对较好，中小市值成长板块表现较弱。

报告期内本基金继续坚持稳健的投资策略，降低了投资组合久期及杠杆率，同时维持较低的权益配置比例。总体以配置为主，同时结合市场环境变化择机进行了结构优化，并积极参与利率债波段操作以增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年06月30日，本基金A类基金份额净值为0.9852元，本报告期份额净值增长率为-0.50%，C类基金份额净值为0.9804元，本报告期份额净值增长率为-0.78%，同期业绩比较基准增长率为0.25%。

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2017年下半年，经济环境总体缓慢下行，货币政策在呵护实体经济以及协调金融监管的双重目的下，偏紧态度有望边际缓和，流动性大幅波动的现象预计难以再现。债券市场在经历了前期大幅调整后，配置价值有所显现，但在全球央行陆续进入紧缩周期、国内货币政策也尚无趋势性转向之际，趋势性行情仍需耐心等待。未来将积极参与利率债波段操作、可转债申购等策略以增厚组合收益。

权益市场下半年不悲观，但存量资金博弈和轮动特征难改，大概率延续结构分化和区间震荡特征，重点关注新能源汽车、电子、医药行业，以及军工板块。

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

本报告期无利润分配。

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“江信祺福债券型证券投资基金2017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：江信祺福债券型证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	700,999.19	2,351,654.81
结算备付金		2,117,682.62	2,094,693.23
存出保证金		22,127.68	26,989.06
交易性金融资产	6.4.7.2	98,589,827.00	265,624,994.00
其中：股票投资		—	11,470,234.00
基金投资		—	—
债券投资		98,589,827.00	254,154,760.00
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	20,100,125.05	—
应收证券清算款		10,272,175.26	—
应收利息	6.4.7.5	1,540,008.26	6,355,209.19
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产		1,399.38	—
资产总计		133,344,344.44	276,453,540.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 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		—	—
卖出回购金融资产款		11,000,000.00	57,799,754.88

应付证券清算款		10,512,495.62	1,203,959.18
应付赎回款		195.89	1,006.42
应付管理人报酬		64,459.11	92,570.47
应付托管费		19,337.72	27,771.13
应付销售服务费		1,306.23	4,067.19
应付交易费用	6.4.7.6	32,551.00	18,418.16
应交税费		—	—
应付利息		1,948.08	20,170.95
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.7	89,260.30	140,000.02
负债合计		21,721,553.95	59,307,718.40
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	113,309,951.49	219,313,108.66
未分配利润	6.4.7.9	-1,687,161.00	-2,167,286.77
所有者权益合计		111,622,790.49	217,145,821.89
负债和所有者权益总计		133,344,344.44	276,453,540.29

6.2 利润表

会计主体：江信祺福债券型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间2016 年01月01日-2016年06 月30日
一、收入		-482,588.79	—
1. 利息收入		4,946,195.19	—
其中：存款利息收入	6.4.7 .10	17,132.86	—
债券利息收入		4,878,088.01	—
资产支持证券利息收入		—	—

买入返售金融资产收入		50,974.32	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益		-11,536,178.74	—
其中：股票投资收益	6.4.7 .11	-1,614,461.10	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7 .12	-9,944,722.64	—
资产支持证券投资收益	6.4.7 .12.3	—	—
贵金属投资收益	6.4.7 .13	—	—
衍生工具收益	6.4.7 .14	2,800.00	—
股利收益	6.4.7 .15	20,205.00	—
3. 公允价值变动收益	6.4.7 .16	6,082,455.79	—
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 .17	24,938.97	—
减：二、费用		1,234,596.62	—
1. 管理人报酬		507,013.37	—
2. 托管费		152,103.94	—
3. 销售服务费		15,066.75	—
4. 交易费用	6.4.7 .18	81,166.67	—
5. 利息支出		370,905.12	—
其中：卖出回购金融资产支出		370,905.12	—
6. 其他费用	6.4.7 .19	108,340.77	—
三、利润总额（亏损总额以“-”		-1,717,185.41	—

号填列)			
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,717,185.41	—

6.3 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：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06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)	219,313,108.66	-2,167,286.77	217,145,821.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,717,185.41	-1,717,185.41
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)	-106,003,157.17	2,197,311.18	-103,805,845.99
其中：1. 基金申购款	48,840.04	-751.23	48,088.81
2. 基金赎回款	-106,051,997.21	2,198,062.41	-103,853,934.80
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)	113,309,951.49	-1,687,161.00	111,622,790.49
项目	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06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)	—	—	—

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	—	—
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)	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
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)	—	—	—

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。

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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年1月1日至2017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2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	700,999.19
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—

其他存款	—
合计	700,999.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2017年06月30日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	32,988,803.47	32,834,327.00	-154,476.47
	银行间市场	65,551,905.00	65,755,500.00	203,595.00
	合计	98,540,708.47	98,589,827.00	49,118.53
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		98,540,708.47	98,589,827.00	49,118.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目		本期末2017年06月30日			备注
		合同/名义金额	公允价值		
			资产	负债	
权益衍生工具		—	—	—	
其他衍生工具		—	—	—	
合计		—	—	—	

注：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

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	10,000,000.00	—
银行间市场	10,100,125.05	—
合计	20,100,125.05	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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：2017年06月30日
应收活期存款利息	1,485.95
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	277.60
应收债券利息	1,540,753.75
应收买入返售证券利息	-2,518.94
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	9.90
合计	1,540,008.26

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	26,336.93
银行间市场应付交易费用	6,214.07
合计	32,551.00

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日

应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	0.15
预提费用	89,260.15
合计	89,260.30

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (江信祺福A)	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	210,572,370.09	210,572,370.09
本期申购	43,266.36	43,266.36
本期赎回	-100,347,122.74	-100,347,122.74
期末数	110,268,513.71	110,268,513.71
项目 (江信祺福C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	8,740,738.57	8,740,738.57
本期申购	5,573.68	5,573.68
本期赎回	-5,704,874.47	-5,704,874.47
期末数	3,041,437.78	3,041,437.78

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目 (江信祺福A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,708,887.97	-5,772,053.39	-2,063,165.42
本期利润	-7,667,275.53	6,028,055.73	-1,639,219.80
本期基金份额交易产生的变动数	1,628,226.84	446,475.42	2,074,702.26
其中：基金申购款	739.06	-1,386.61	-647.55
基金赎回款	1,627,487.78	447,862.03	2,075,349.81

本期已分配利润	—	—	—
本期末	-2,330,160.72	702,477.76	-1,627,682.96

单位：人民币元

项目 (江信祺福C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	135,020.42	-239,141.77	-104,121.35
本期利润	-132,365.67	54,400.06	-77,965.61
本期基金份额交易产生的变动数	-81,166.18	203,775.10	122,608.92
其中：基金申购款	89.05	-192.73	-103.68
基金赎回款	-81,255.23	203,967.83	122,712.60
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-78,511.43	19,033.39	-59,478.04

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
活期存款利息收入	12,800.29
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	4,156.50
其他	176.07
合计	17,132.86

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
----	-------------------------------

卖出股票成交总额	32,508,356.40
减：卖出股票成本总额	34,122,817.50
买卖股票差价收入	-1,614,461.10

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06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	-9,944,722.64
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	-9,944,722.64

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	331,312,656.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	335,811,177.74
减：应收利息总额	5,446,201.18
买卖债券差价收入	-9,944,722.64

6.4.7.12.3 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本报告期内，本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
股票投资产生的股利收益	20,205.00
基金投资产生的股利收益	—
合计	20,205.00

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
1. 交易性金融资产	6,082,455.79
——股票投资	503,791.42
——债券投资	5,578,664.37
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	6,082,455.79

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
基金赎回费收入	24,938.97

合计	24,938.97
----	-----------

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
交易所市场交易费用	76,844.35
银行间市场交易费用	4,312.50
期货交易费用	9.82
合计	81,166.67

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
审计费用	—
信息披露费	49,588.57
帐户维护费	18,000.00
其他费用	1,080.62
审计费用-大华会计师事务所	39,671.58
合计	108,340.77

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

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，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，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，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

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	507,013.37	—
其中：支付销售机构的客户维护费	415.91	—

注：1、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

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	152,103.94	—

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

6.4.10.2.3 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 2017年01月01日-2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	江信祺福A	江信祺福C	合计
国盛证券有限责任公司	—	14,103.71	14,103.71
中国光大银行股份有限公司	—	361.56	361.56
江信基金管理有限公司	—	405.88	405.88
合计	—	14871.15	14871.15

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

本报告期内及去年同期，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**

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期内，除本基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2017年01月01日-2017年06月30 日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06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	700,999.19	12,800.29		

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

本报告期内，本基金无其他关联交易事项的说明。

上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年06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**

本报告期末无因认购新股/新债而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本报告期末未持有暂时停牌股票。

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

本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017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11,000,000.00元，全部于2017年7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。

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2017年06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43.19%。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	—	20,012,000.00
A-1以下	—	—
未评级	19,985,000.00	19,858,000.00
合计	19,985,000.00	39,870,000.00

注：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 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	—	61,059,000.00
AAA以下	28,227,160.00	76,585,760.00
未评级	—	—
合计	28,227,160.00	137,644,760.00

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无国债、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制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%，本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%。因此除附注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2017年06月30日，除卖出回购金融资产款余额中有11,000,000.00元将在1个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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。

本基金部分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 2017年06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	700,999.19	—	—	—	700,999.19
结算备付金	2,117,682.62	—	—	—	2,117,682.62
存出保证金	22,127.68	—	—	—	22,127.68
交易性金融资产	42,906,327.00	45,722,500.00	9,961,000.00	—	98,589,827.00
买入返售金融资产	20,100,125.05	—	—	—	20,100,125.05
应收证券清算款	—	—	—	10,272,175.26	10,272,175.26
应收利息	—	—	—	1,540,008.26	1,540,008.26
其他资产	—	—	—	1,399.38	1,399.38
资产总计	65,847,261.54	45,722,500.00	9,961,000.00	11,813,582.90	133,344,344.44
负债					
卖出回购金融资产款	11,000,000.00	—	—	—	11,000,000.00
应付证券清算款	—	—	—	10,512,495.62	10,512,495.62
应付赎回款	—	—	—	195.89	195.89
应付管理人报酬	—	—	—	64,459.11	64,459.11
应付托管费	—	—	—	19,337.72	19,337.72
应付销售服务费	—	—	—	1,306.23	1,306.23
应付交易费用	—	—	—	32,551.00	32,551.00

应付利息	—	—	—	1,948.08	1,948.08
其他负债	—	—	—	89,260.30	89,260.30
负债总计	11,000,000.00	—	—	10,721,553.95	21,721,553.95
利率敏感度缺口	54,847,261.54	45,722,500.00	9,961,000.00	1,092,028.95	111,622,790.49
上年度末 2016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	2,351,654.81	—	—	—	2,351,654.81
结算备付金	2,094,693.23	—	—	—	2,094,693.23
存出保证金	26,989.06	—	—	—	26,989.06
交易性金融资产	59,061,234.00	105,817,760.00	100,746,000.00	—	265,624,994.00
应收利息	—	—	—	6,355,209.19	6,355,209.19
资产总计	63,534,571.10	105,817,760.00	100,746,000.00	6,355,209.19	276,453,540.29
负债					
卖出回购金融资产款	57,799,754.88	—	—	—	57,799,754.88
应付证券清算款	—	—	—	1,203,959.18	1,203,959.18
应付赎回款	—	—	—	1,006.42	1,006.42
应付管理人报酬	—	—	—	92,570.47	92,570.47
应付托管费	—	—	—	27,771.13	27,771.13
应付销售服务费	—	—	—	4,067.19	4,067.19

应付交易费用	—	—	—	18,418.16	18,418.16
应付利息	—	—	—	20,170.95	20,170.95
其他负债	—	—	—	140,000.02	140,000.02
负债总计	57,799,754.88	—	—	1,507,963.52	59,307,718.40
利率敏感度缺口	5,734,816.22	105,817,760.00	100,746,000.00	4,847,245.67	217,145,821.89

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 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	1. 市场利率上升 25 个基点	-243,033.98	-1,824,069.77
	2. 市场利率下降 25 个基点	244,981.11	1,848,500.62

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%。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	—	—	11,470,234.00	5.28
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	—	—	11,470,234.00	5.28

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降5%		
假设	2. 其他市场变量保持不变		
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 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	权益性投资的市场价格上升5%	—	573,511.70
	权益性投资的市场价格下降5%	—	-573,511.70

注：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2017年06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0元，属于第二层级的余额为98,589,827.00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	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	98,589,827.00	73.94

	其中：债券	98,589,827.00	73.94
	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	20,100,125.05	15.07
	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	2,818,681.81	2.11
6	其他资产	11,835,710.58	8.88
7	合计	133,344,344.44	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末按行业分类的股票投资组合

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	—	—
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：本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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 (%)
1	300144	宋城演艺	2,088,987.00	0.96
2	600085	同仁堂	1,580,504.00	0.73
3	002186	全聚德	1,198,200.00	0.55
4	601919	中远海控	1,182,500.00	0.54
5	000848	承德露露	1,144,356.40	0.53
6	601118	海南橡胶	1,137,900.00	0.52
7	300421	力星股份	982,500.00	0.45
8	600429	三元股份	792,000.00	0.36
9	002027	分众传媒	785,800.00	0.36
10	601211	国泰君安	719,200.00	0.33
11	600026	中远海能	714,785.64	0.33
12	600160	巨化股份	680,000.00	0.31
13	002142	宁波银行	676,000.00	0.31
14	600195	中牧股份	626,956.00	0.29

15	000967	盈峰环境	603,384.00	0.28
16	601998	中信银行	603,000.00	0.28
17	600000	浦发银行	602,400.00	0.28
18	600837	海通证券	591,600.00	0.27
19	002371	北方华创	570,000.00	0.26
20	600171	上海贝岭	534,219.04	0.25

7.4.2 累计卖出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 (%)
1	600160	巨化股份	2,317,193.00	1.07
2	601118	海南橡胶	2,255,400.00	1.04
3	300144	宋城演艺	2,130,374.24	0.98
4	600085	同仁堂	1,983,120.00	0.91
5	002186	全聚德	1,356,858.55	0.62
6	600429	三元股份	1,355,346.00	0.62
7	600637	东方明珠	1,249,114.00	0.58
8	601919	中远海控	1,192,000.00	0.55
9	000848	承德露露	1,029,632.50	0.47
10	601567	三星医疗	977,993.87	0.45
11	002027	分众传媒	852,800.00	0.39
12	002170	芭田股份	812,000.00	0.37
13	300421	力星股份	798,913.00	0.37
14	600195	中牧股份	756,439.00	0.35
15	601211	国泰君安	720,000.00	0.33
16	000801	四川九洲	714,400.00	0.33
17	600026	中远海能	711,829.12	0.33
18	002142	宁波银行	690,400.00	0.32
19	600221	海航控股	688,000.00	0.32
20	000967	盈峰环境	620,000.00	0.29

7.4.3 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	22,148,792.08
卖出股票收入（成交）总额	32,508,356.40

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	19,934,667.00	17.86
2	央行票据	—	—
3	金融债券	30,443,000.00	27.27
	其中：政策性金融债	30,443,000.00	27.27
4	企业债券	28,227,160.00	25.29
5	企业短期融资券	19,985,000.00	17.90
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	98,589,827.00	88.32

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	018005	国开1701	200,000	19,916,000.00	17.84
2	140203	14国开03	100,000	10,527,000.00	9.43
3	1080077	10马建投债	100,000	10,003,000.00	8.96
4	011753026	17联通SCP001	100,000	9,997,000.00	8.96
5	011698725	16国电	100,000	9,988,000.00	8.95

		SCP006			
--	--	--------	--	--	--

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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，进行套期保值操作。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 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空头套期保值策略，用于对冲投资组合持有的现券多头头寸。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期末未持有股票，不存在投资于超过基金合同规定备选股票库之

外的情况。

7.12.2 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。

7.12.3 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	22,127.68
2	应收证券清算款	10,272,175.26
3	应收股利	—
4	应收利息	1,540,008.26
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	1,399.38
8	其他	—
9	合计	11,835,710.58

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在限售流通的情况。

7.12.6 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。

§ 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

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	196	562,594.46	109,863,437.64	99.63%	405,076.07	0.37%
江信祺福C	647	4,700.83	—	—	3,041,437.78	100.00%
合计	843	134,412.75	109,863,437.64	96.96%	3,446,513.85	3.04%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	江信祺福A	14,974.33	0.01%
	江信祺福C	5,527.39	0.18%
	合计	20,501.72	0.18%

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	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、基金投资和相关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	0~10
	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	0~10
	合计	0~10

§9 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)	201,161,436.75	22,731,209.10

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	210,572,370.09	8,740,738.57
本报告期基金总申购份额	43,266.36	5,573.68
减：本报告期基金总赎回份额	100,347,122.74	5,704,874.47
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	110,268,513.71	3,041,437.78

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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 基金改聘会计师事务所情况

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监管部门稽查或处罚的情况

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金	占当期股票	佣金	占当期佣金	

	数量	额	成交总额比例		总量的比例	
长城证券	2	22,285,559.21	40.78%	16,297.33	41.45%	
国盛证券	2	—	—	—	—	
民族证券	1	32,364,779.27	59.22%	23,021.13	58.55%	

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
长城证券	2,997,797.9	1.88%	21,722,000	4.12%	—	—
国盛证券	77,784,800	48.78%	—	—	—	—
民族证券	78,669,978.8	49.34%	505,600,000	95.88%	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	江信祺福债券型证券投资基金年度最后一个市场自然日净值公告	证券日报、公司网站	2017-01-03
2	江信基金增加中泰证券为代销机构的公告	证券日报、公司网站	2017-01-14
3	江信基金增加金斧子为代销机构的公告	证券日报、公司网站	2017-01-14
4	江信祺福债券型证券投资基金2016年第4季度报告	证券日报、公司网站	2017-01-21
5	江信基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金费率优惠的公告	证券日报、公司网站	2017-02-22
6	江信基金管理有限公司关于参加	证券日报、公司网站	2017-02-25

	钱景财富基金费率优惠的公告		
7	江信基金增加虹点基金为代销机构的公告	证券日报、公司网站	2017-03-07
8	江信祺福债券型证券投资基金招募说明书更新（2017年第1号）	公司网站	2017-03-11
9	江信祺福债券型证券投资基金招募说明书更新摘要（2017年第1号）	证券日报、公司网站	2017-03-11
10	江信基金增加众禄基金为代销机构的公告	证券日报、公司网站	2017-03-29
11	江信祺福债券型证券投资基金2016年年度报告	公司网站	2017-03-31
12	江信祺福债券型证券投资基金2017年年度报告摘要	证券日报、公司网站	2017-03-31
13	江信祺福债券型证券投资基金2017年第1季度报告	证券日报、公司网站	2017-04-24
14	江信添福债券型证券投资基金2017年第1季度报告	证券日报、公司网站	2017-04-24
15	江信基金增加北京肯特瑞财富为代销机构的公告	证券日报、公司网站	2017-04-25
16	江信基金增加一路财富为代销机构的公告	证券日报、公司网站	2017-05-10
17	江信基金增加盈米财富为代销机构的公告	证券日报、公司网站	2017-05-17
18	江信基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	证券日报、公司网站	2017-06-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间区间					
机构	1	2017年1月1日 至2017年6月 30日	20000 6777.7 7		10000 0000	100006777 .77	0.8826
产品特有风险							
无							

11.2 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. 中国证监会准予江信祺福债券型证券投资基金募集注册的文件；
2. 《江信祺福债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《江信祺福债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《江信祺福债券型证券投资基金招募说明书》；
5. 法律意见书；
6. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
7. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
8. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.jxfund.cn>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

江信基金管理有限公司
二〇一七年八月二十六日