江信一年定期开放债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:2026 年 08 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月21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2026年01月01日起至2026年06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遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 41
7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
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 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 42
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 43
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 43
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 43
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 43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.12 投资组合报告附注 44
§8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46

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 46
§9 开放式基金份额变动 46
§10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 47
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 48
10.8 其他重大事件 50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 52
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 52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 52
§12 备查文件目录 52
12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 52
12.3 查阅方式 53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	江信一年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	江信一年定开
基金主代码	003390
交易代码	003390
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年04月17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	25,117,655.89份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1、信用债投资策略 本基金将重点投资信用类债券，以提高组合收益能力。信用债券相对央行票据、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源，本基金将积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。 债券的信用利差主要受两个方面的影响，一是市场信用利差曲线的走势；二是债券本身的信用变化。本基金依靠对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等的分析，判断市场信用利差曲线整体及分行业走势，确定各期限、各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资，减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。 2、收益率曲线策略

	收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化，相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略；其次，通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较，可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。 3、杠杆放大策略 杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。 4、资产支持证券投资策略 当前国内资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 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。
业绩比较基准	中债总财富（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券市场中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人

名称		江信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙剑	王茵
	联系电话	400-622-0583	010-63639180
	电子邮箱	customer@jxfund.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-622-0583	95595
传真		010-57380988	010-63639132
注册地址		北京市海淀区复兴路69号院11号楼3层101	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		北京市海淀区西直门外大街168号腾达大厦19层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100039	100033
法定代表人		孙桢磉	吴利军

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.jxfund.cn
基金中期报告置备地点	北京市海淀区西直门外大街168号腾达大厦19层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	江信基金管理有限公司	北京市海淀区西直门外大街168号腾达大厦19层

§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（2026年01月01日- 2026年06月30日）
本期已实现收益	1,481,523.39

本期利润	1,550,899.98
加权平均基金份额本期利润	0.0446
本期加权平均净值利润率	3.49%
本期基金份额净值增长率	2.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 （2026年06月30日）
期末可供分配利润	2,348,878.43
期末可供分配基金份额利润	0.0935
期末基金资产净值	31,972,878.13
期末基金份额净值	1.2729
3.1.3 累计期末指标	报告期末 （2026年06月30日）
基金份额累计净值增长率	31.28%

1、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。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、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。

4、表中的“期末”均指报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.70%	0.08%	1.17%	0.05%	-1.87%	0.03%
过去六个月	2.75%	0.17%	1.98%	0.05%	0.77%	0.12%
过去一年	1.07%	0.32%	1.33%	0.07%	-0.26%	0.25%
过去三年	6.11%	0.19%	12.87%	0.09%	-6.76%	0.10%
过去五年	15.67%	0.15%	23.86%	0.09%	-8.19%	0.06%

过去七年	19.47%	0.22%	34.01%	0.10%	-14.54%	0.12%
自基金合同生效起至今	31.28%	0.19%	48.18%	0.10%	-16.90%	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

§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：国盛证券股份有限公司、安徽恒生阳光控股有限公司、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2026年06月30日，本基金管理人管理的产品有公募基金与资产管理计划，其中的公募基金有：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、江信增利货币市场基金。

本报告期本基金管理人股东变化情况：2026年01月31日国盛证券股份有限公司发布《国盛证券股份有限公司关于全资子公司国盛证券有限责任公司完成注销登记的公告》，国盛证券有限责任公司已于2026年01月30日完成工商注销登记，国盛证券股份有限公司完成承接江信基金管理有限公司5400万元人民币出资，占注册资本比例30%的事项。江信基金管理有限公司主要股东亦由国盛证券有限责任公司变更为国盛证券股份有限公司且已完成工商变更登记。

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		
马超然	本基金的基金经理	2023-05-12	-	12年	马超然先生，硕士研究生。自2013年起，先后就职于民生加银资产管理有限公司、华夏久盈资产管理有限责任公司、天津信托有限责任公司。2022年11月加入江信基金管理有限公司，任职于固定收益投资总部。现担任江信增利货币市场基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金、江信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、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。具有基金从业资格。中国国籍。

1、任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期或基金成立日期填写；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金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

为保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者的合法权益，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》，形成涵盖封闭式基金、开放式基金和资产管理计划的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等投资市场，并包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人通过不断完善研究方法和投资决策流程，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合享有公平的投资决策机会；公司严格贯彻投资管理职能和交易执行职能相隔离的原则，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；公司不断加强对投资交易行为的监察稽核力度，确保做好对公平交易各环节的监控和分析评估工作。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易行为。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价交易，未出现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

上半年，本组合以可转债为主要投资方向，权益市场经历了“先扬后抑再修复”的剧烈波动。

开年权益市场显著上涨，但随着指数多次创出新高、市场估值显著抬升，叠加美伊冲突等地缘政治局势恶化，市场风险偏好骤然下降。4月上旬，受多重因素共振影响，

上证指数从阶段性高位快速回调，最大跌幅一度超过8%，可转债市场同步承压，中证转债指数在4月中旬跌至年内低点。

面对市场剧烈波动，本组合严格执行了“通过仓位调整获取超额收益”的方针。一季度末即预判“路径曲折程度可能超出原先预想”，在4月初市场恐慌初期即大幅降低仓位，有效规避了主跌浪的净值损失。4月下旬起，随着政策托底信号明确、市场情绪逐步修复，重点布局景气度改善明确、转债估值具备安全边际的个券，但是由于市场修复速度比预想更快，仓位水平始终较低。

在择时策略上，坚持“降低择时频率是提高择时胜率的关键”这一理念，将在调整时勇于加仓，在有基本面的前提下，珍惜调整提供的空间，同时注意规避高溢价品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末江信一年定开基金份额净值为1.2729元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.75%，同期业绩比较基准收益率为1.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济预计延续“温和复苏、结构分化”的态势。

积极因素方面，稳增长政策持续发力，财政端专项债发行提速、特别国债落地形成实物工作量，基建投资有望维持中高速增长。货币政策维持适度宽松基调，资金面大幅收紧的风险有限，流动性环境对实体经济仍构成支撑。以AI产业链、高端制造为代表的新质生产力领域持续扩容，成为拉动经济增长的重要引擎。

风险因素方面，外部地缘政治局势仍存在较大不确定性，中东冲突、大国博弈等因素可能阶段性冲击全球风险偏好，输入性通胀压力虽边际缓和但尚未完全消除。内需层面，消费修复动能偏弱，房地产市场仍处于筑底阶段，有效需求不足的问题尚未根本解决，经济复苏的可持续性仍需观察。

对于市场当下的K型分化，由于AI产业链是生产力在当前技术水平下最有希望的突破口，因此不存在高低切。如果生产力突破失败，只能从分配方式这个角度形成新的变化，叠加地缘政策的不确定性，到时的波动可能将比2000年与1929年更为剧烈。

所以从走势上看，寻找低止损空间的交易，如果趋势依旧，那么上涨空间巨大。如果趋势不再，那么止损空间会较小，盈亏比与赔率均较优。

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《估值委员会工作细则》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、会计、研究、风控、合规等岗位资深人员。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

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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

本基金自2026年4月20日至本报告期末，期间基金资产净值低于5000万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在江信一年定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本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。同时，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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行

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、利润分配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有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期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以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

§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：江信一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,415,002.47	2,715,767.41
结算备付金		345,551.65	384,822.46
存出保证金		8,971.27	11,021.17
交易性金融资产	6.4.7.2	26,279,457.61	44,119,232.80
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		26,279,457.61	44,119,232.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	4,002,564.37
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		32,048,983.00	51,233,408.21
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		18,437.41	30,163.69
应付托管费		2,633.92	4,309.10
应付销售服务费		2,633.92	4,309.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		948.68	751.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	51,450.94	110,325.00
负债合计		76,104.87	149,858.00
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	25,117,655.89	41,237,151.57
未分配利润	6.4.7.8	6,855,222.24	9,846,398.64
净资产合计		31,972,878.13	51,083,550.21
负债和净资产总计		32,048,983.00	51,233,408.21

报告截止日2026年6月30日，基金份额净值1.2729元，基金份额总额25,117,655.89份。

6.2 利润表

会计主体：江信一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
一、营业总收入		1,834,669.21	693,967.55
1.利息收入		19,041.85	108,762.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,184.77	28,978.03
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,857.08	79,084.68
其他利息收入		-	700.00
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,746,250.40	692,883.84
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,746,250.40	665,848.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	27,035.64
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	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	69,376.59	-107,679.00
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	0.37	-
减：二、营业总支出		283,769.23	308,822.08
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	154,885.95	177,988.41
2.托管费	6.4.10.2.2	22,126.53	25,426.88
3.销售服务费	6.4.10.2.3	22,126.53	25,426.88
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	6,028.01
其中：卖出回购金融资产支出		-	6,028.01
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		781.78	803.93
8.其他费用	6.4.7.20	83,848.44	73,147.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,550,899.98	385,145.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,550,899.98	385,145.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,550,899.98	385,145.47

6.3 净资产变动表

会计主体：江信一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	41,237,151.57	9,846,398.64	51,083,550.21
二、本期期初净资	41,237,151.57	9,846,398.64	51,083,550.21

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,119,495.68	-2,991,176.40	-19,110,672.08
（一）、综合收益总额	-	1,550,899.98	1,550,899.98
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-16,119,495.68	-4,542,076.38	-20,661,572.06
其中：1.基金申购款	8,184.50	2,304.80	10,489.30
2.基金赎回款	-16,127,680.18	-4,544,381.18	-20,672,061.36
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	25,117,655.89	6,855,222.24	31,972,878.13
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	41,791,952.02	10,453,810.38	52,245,762.40
二、本期期初净资产	41,791,952.02	10,453,810.38	52,245,762.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-554,800.45	244,253.30	-310,547.15
（一）、综合收益总额	-	385,145.47	385,145.47

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-554,800.45	-140,892.17	-695,692.62
其中：1.基金申购款	15,989,048.07	4,041,391.93	20,030,440.00
2.基金赎回款	-16,543,848.52	-4,182,284.10	-20,726,132.62
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	41,237,151.57	10,698,063.68	51,935,215.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

孙剑	孙剑	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

江信一年定期开放债券型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2016]2076号文《关于准予江信一年定期开放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《江信一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责在2017年3月6日至2017年4月12日公开募集，基金代码为003390。

本基金为契约型开放式，每12个月开放一次，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集426,886,986.41元，已经大华会计师事务所(特殊普通合伙)大华验字[2017]000251号验资报告予以验证。经中国证监会备案，《江信一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2017年4月17日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为426,887,708.19份基金份额，其中认购资金利息折合721.78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。

本基金主要投资于国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、地方政府债、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金不参与新股申购或增发新股；不直接从市场买入股票、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。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比例不低于基金资产的80%，但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，基金投资不受上述比例限制；开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，在封闭期，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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：中债总财富(总值)指数收益率。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2026年8月31日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

（一）编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)，同时参照《资产管理产品相关会计处理规定》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号——会计报表附注的编制及披露》以及《证券投资基金会计核算业务指引》等财政部、中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定编制财务报表。

（二）持续经营能力评价

本基金不存在导致对报告期末起12个月内的持续经营假设产生重大疑虑的事项或情况。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则，同时参照《资产管理产品相关会计处理规定》《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号——定期报告的内容与格式》《证券投资基金信息披露编报规则第3号——会计报表附注的编制及披露》以及《证券投资基金会计核算业务指引》等财政部、中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

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

本期本基金无会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本期本基金无会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本期本基金无差错更正事项。

6.4.6 税项

1、主要税种及税率

税 种	计税依据	税 率
增值税	销售货物或提供应税劳务过程中产生的增值额	按3%税率计缴
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	25%

2、税收优惠及批文

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财

税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，本基金主要享有以下税收优惠：

（1）于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

（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，应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。

（4）本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	5,415,002.47
等于：本金	5,414,893.04
加：应计利息	109.43
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-

存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,415,002.47

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	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	26,368,669.29	145,675.61	26,279,457.61	-234,887.29
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	26,368,669.29	145,675.61	26,279,457.61	-234,887.29
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		26,368,669.29	145,675.61	26,279,457.61	-234,887.29

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

本报告期末，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 其他资产

本期末，本基金无其他资产（应收利息、其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	202.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	202.50
应付利息	-
预提费用	51,248.44
合计	51,450.94

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	41,237,151.57	41,237,151.57
本期申购	8,184.50	8,184.50
本期赎回（以“-”号填列）	-16,127,680.18	-16,127,680.18
本期末	25,117,655.89	25,117,655.89

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	2,353,560.57	7,492,838.07	9,846,398.64

本期期初	2,353,560.57	7,492,838.07	9,846,398.64
本期利润	1,481,523.39	69,376.59	1,550,899.98
本期基金份额交易产生的变动数	-1,486,205.53	-3,055,870.85	-4,542,076.38
其中：基金申购款	753.31	1,551.49	2,304.80
基金赎回款	-1,486,958.84	-3,057,422.34	-4,544,381.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,348,878.43	4,506,343.81	6,855,222.24

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	1,676.40
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	487.25
其他	21.12
合计	2,184.77

本报告期内"其他"为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本期本基金无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

本期本基金无基金投资收益。

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 2026年01月01日至2026年06月30日

债券投资收益——利息收入	274,749.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,471,500.78
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	1,746,250.40

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	141,397,131.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	138,966,390.36
减：应计利息总额	956,145.62
减：交易费用	3,094.66
买卖债券差价收入	1,471,500.78

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本期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

本期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本期本基金无买卖权证价差收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本期本基金无衍生工具——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本期本基金无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	69,376.59
——股票投资	-
——债券投资	69,376.59
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	69,376.59

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	0.37
合计	0.37

6.4.7.19 信用减值损失

本期本基金无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	36,372.05
证券出借违约金	-
帐户维护费	18,000.00
其他费用	14,600.00
合计	83,848.44

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

截止本报告期期末，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告日止，本公司无应披露未披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期本基金管理人的主要股东由国盛证券有限责任公司变更为国盛证券股份有限公司：

2026年01月31日国盛证券股份有限公司发布《国盛证券股份有限公司关于全资子公司国盛证券有限责任公司完成注销登记的公告》，国盛证券有限责任公司已于2026年01月30日完成工商注销登记，国盛证券股份有限公司完成承接江信基金管理有限公司5400万元人民币出资，占注册资本比例30%的事项。江信基金管理有限公司主要股东亦由国盛证券有限责任公司变更为国盛证券股份有限公司且已完成工商变更登记。

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
国盛证券股份有限公司	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

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

本报告期内及去年同期，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国盛证券股份有限公司	181,062,010.72	69.13%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国盛证券	86,620,000.00	41.11%	-	-

股份有限公司				

6.4.10.1.5 基金交易

本报告期内及去年同期，本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本报告期及去年同期，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

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	154,885.95	177,988.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,224.83	9,708.84
应支付基金管理人的净管理费	144,661.12	168,279.57

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%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×0.70%÷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 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	22,126.53	25,426.88

注：基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.10%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×0.10%÷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 2026年01月01日至2026年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国盛证券股份有限公司	-
中国光大银行股份有限公司	42.03
江信基金管理有限公司	17,355.49
合计	17,397.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国盛证券有限责任公司	-
中国光大银行股份有限公司	48.77
江信基金管理有限公司	20,971.95
合计	21,020.72

注：本基金销售服务费按前一日基金份额的基金资产净值0.10%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H为基金份额每日应计提的销售服务费

E为基金份额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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期内及去年同期，本基金未参与转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期内及去年同期，本基金未参与转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	5,415,002.47	1,676.40	146,233.74	23,260.96

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。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期间，本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本报告期内，本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026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等流通受限股票

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

截至本报告期末，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，本基金无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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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

1、风险管理政策

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。

2、风险治理组织架构

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。本基金信用风险主要来自银行存款、债券投资、资产支持证券投资等。

本基金的银行存款主要存放于托管行中国光大银行股份有限公司，该银行系信用评级较高的金融机构，本基金预期银行存款不存在重大的信用风险。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。本基金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。

本基金的管理人建立了信用风险管理流程，通过对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能的信用风险。

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。

本基金没有提供任何其他可能令本基金承受信用风险的担保。本基金所承担的最大信用风险敞口为资产负债表中各项金融资产的账面价值。

1．信用风险显著增加的判断依据

本基金在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。在确定信用风险自初始确认后是否显著增加时，本基金考虑在无须付出不必要的额外成本或努力即可获得合理且有依据的信息，包括基于本基金历史数据的定性和定量分析、外部信用风险评级以及前瞻性信息。当满足以下一个或多个定量、定性标准时，本基金认为信用风险已显著增加：

(1)合同付款已逾期超过30天。

(2)根据外部公开信用评级结果，债务人信用评级等级大幅下降。

(3)债务人生产或经营环节出现严重问题，经营成果实际或预期发生显著下降。

(4)债务人所处的监管、经济或技术环境发生显著不利变化。

(5)预期将导致债务人履行其偿债义务能力的业务、财务或经济状况发生显著不利变化。

(6)其他表明金融资产发生信用风险显著增加的客观证据。

2．已发生信用减值的依据

本基金评估债务人是否发生信用减值时，主要考虑以下因素：

(1)发行方或债务人发生重大财务困难。

(2)债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等。

(3)债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步。

(4)债务人很可能破产或进行其他财务重组。

(5)发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失。

(6)以大幅折扣购买或源生一项金融资产，该折扣反映了发生信用损失的事实。

3．预期信用损失计量的参数

根据信用风险是否发生显著增加以及是否已发生信用减值，本基金对不同的资产分别以12个月或整个存续期的预期信用损失计量损失准备。预期信用损失计量的关键参数包括违约概率、违约损失率和违约风险敞口。本基金考虑历史统计数据的定量分析及前瞻性信息，建立违约概率、违约损失率及违约风险敞口模型。相关定义如下：

(1)违约概率是指债务人在未来12个月或在整个剩余存续期，无法履行其偿付义务的可能性。

(2)违约风险敞口是指，在未来12个月或在整个剩余存续期中，在违约发生时，本基金应被偿付的金额。

(3)违约损失率是指本基金对违约敞口发生损失程度作出的预期。根据交易对手的类型、追索的方式和优先级，以及担保物或其他信用支持的可获得性不同，违约损失率也有所不同。

本基金通过预计未来各月份中单个敞口或资产组合的违约概率、违约损失率和违约风险敞口，来确定预期信用损失。本报告期内，预期信用损失估计技术或关键假设未发生重大变化。

4．预期信用损失模型中包括的前瞻性信息

信用风险显著增加的评估及预期信用损失的计算均涉及前瞻性信息。本基金通过历史数据分析，识别出影响各资产组合的信用风险及预期信用损失的相关信息，如GDP增速等宏观经济状况，所处行业周期阶段等行业发展状况等。本基金在考虑基金未来销售策略或信用政策的变化的基础上来预测这些信息对违约概率和违约损失率的影响。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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。本报告期末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	1,372,382.28	17,291,025.49
AAA以下	1,757,991.22	26,828,207.31
未评级	-	0.00
合计	3,130,373.50	44,119,232.80

以上按长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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。本基金投资于一家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%。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。

本基金所承担的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

金融工具的市场风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

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未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的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2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,415,002.47	-	-	-	5,415,002.47
结算备付金	345,551.65	-	-	-	345,551.65
存出保证金	8,971.27	-	-	-	8,971.27
交易性金融资产	23,149,084.11	2,735,274.65	395,098.85	-	26,279,457.61
资产总计	28,918,609.50	2,735,274.65	395,098.85	-	32,048,983.00
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	18,437.41	18,437.41
应付托	-	-	-	2,633.92	2,633.92

管费					
应付销售服务费	-	-	-	2,633.92	2,633.92
应交税费	-	-	-	948.68	948.68
其他负债	-	-	-	51,450.94	51,450.94
负债总计	-	-	-	76,104.87	76,104.87
利率敏感度缺口	28,918,609.50	2,735,274.65	395,098.85	-76,104.87	31,972,878.13
上年度末2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,715,767.41	-	-	-	2,715,767.41
结算备付金	384,822.46	-	-	-	384,822.46
存出保证金	11,021.17	-	-	-	11,021.17
交易性金融资产	4,074,167.28	32,876,415.94	7,168,649.58	-	44,119,232.80
买入返售金融资产	4,002,564.37	-	-	-	4,002,564.37
资产总计	11,188,342.69	32,876,415.94	7,168,649.58	-	51,233,408.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	30,163.69	30,163.69

应付托管费	-	-	-	4,309.10	4,309.10
应付销售服务费	-	-	-	4,309.10	4,309.10
应交税费	-	-	-	751.11	751.11
其他负债	-	-	-	110,325.00	110,325.00
负债总计	-	-	-	149,858.00	149,858.00
利率敏感度缺口	11,188,342.69	32,876,415.94	7,168,649.58	-149,858.00	51,083,550.21

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	除市场利率以外的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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率上升25.00bp	-54,169.50	-328,036.39
	市场利率下降25.00bp	54,529.76	331,979.33

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。本基金持有的金融工具主要以人民币计价，因此本基金所承担的外汇变动市场风险不重大。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。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比例不低于基金资产的80%。开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。在封闭期，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本期末，本基金未持有交易性权益类投资，因此无其他价格风险敞口。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利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 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

（1）基金对金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（2）各层次金融工具举例

第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	3,130,373.50	43,096,746.50
第二层次	23,149,084.11	1,022,486.30
第三层次	-	-
合计	26,279,457.61	44,119,232.80

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本报告期内，本基金不存在公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期内，本基金不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本报告期内，本基金不存在持有不以公允价值计量的金融工具的情况。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,279,457.61	82.00
	其中：债券	26,279,457.61	82.00
	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	5,760,554.12	17.97
8	其他各项资产	8,971.27	0.03
9	合计	32,048,983.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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所有股票投资明细

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	23,149,084.11	72.40
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,130,373.50	9.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,279,457.61	82.19

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	019827	26国债01	230,000	23,149,084.11	72.40
2	127045	牧原转债	5,000	586,804.79	1.84
3	127110	广核转债	3,000	395,098.85	1.24
4	113056	重银转债	2,000	249,141.86	0.78
5	127103	东南转债	1,500	216,090.62	0.68

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，除以下证券外，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。

（1）本基金持有的重银转债（代码：113056.SH）的发行主体重庆银行股份有限公司于2025年10月22日被重庆金融监管局处以罚款共计220万元（渝金管罚决字〔2025〕23号）；于2025年11月27日被国家外汇管理局重庆市分局处以警告，罚款，没收违法所得182.70万元（渝汇罚〔2025〕7号）。

（2）本基金持有的万凯转债（代码：123247.SZ）的发行主体万凯新材料股份有限公司于2025年11月19日被中国证券监督管理委员会浙江监管局采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案（〔2025〕281 号）。

7.12.2 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约定备选股票库之外的情况。

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	8,971.27
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,971.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127045	牧原转债	586,804.79	1.84
2	127110	广核转债	395,098.85	1.24
3	113056	重银转债	249,141.86	0.78
4	127103	东南转债	216,090.62	0.68
5	127082	亚科转债	193,988.24	0.61
6	113058	友发转债	191,612.45	0.60
7	123247	万凯转债	180,140.79	0.56
8	118013	道通转债	165,366.23	0.52
9	123257	安克转债	146,900.44	0.46
10	127067	恒逸转2	144,553.81	0.45
11	113691	和邦转债	141,844.99	0.44
12	113066	平煤转债	141,336.78	0.44
13	127072	博实转债	133,156.90	0.42
14	113631	皖天转债	131,364.90	0.41
15	127070	大中转债	112,971.85	0.35

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
265	94,783.61	24,919,646.37	99.21%	198,009.52	0.79%

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	3,121.77	0.01%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年04月17日)基金份额总额	426,887,708.19
本报告期期初基金份额总额	41,237,151.57
本报告期基金总申购份额	8,184.50
减：本报告期基金总赎回份额	16,127,680.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,117,655.89

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自2026年3月18日起至2026年4月20日止，本次大会于2026年4月21日计票表决并通过了《关于江信一年定期开放债券型证券投资基金修改基金合同终止条款的议案》。

自2026年4月21日起，基金合同的本次修订生效，修订内容为：

将《基金合同》“第五部分 基金的存续”中的如下内容由：

“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，本基金合同将终止或与其他基金合并，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。

在每个开放期最后一个开放日结束后，如果出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，本基金合同将终止或与其他基金合并，无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。”

修改为：

“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。”

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

1、本报告期内，基金管理人重大人事变动如下：

2026年3月18日原督察长郑清丽女士离任，董事长孙剑先生代任督察长职务。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

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

在本报告期内，本基金未改聘会计事务所，为本基金提供审计服务的会计师事务所为中汇会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	江信基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年06月26日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施

受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、其他问题（内部管理）
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已通过完善制度及优化流程等方式采取整改措施，待后续向监管部门报送整改完成报告。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛	2	-	-	-	-	-

证券						
金融街证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

1、证券公司选择标准

公司通过开展尽职调查，选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究能力较强、佣金率优惠的证券公司作为公司旗下公募基金的证券经纪商。

2、证券公司选择程序

公司根据以上标准对不同证券公司进行考察、选择和确定，并与选定的证券公司签订委托协议，明确双方权利义务、佣金率、服务内容、委托代理期限、违约责任等内容。

3、租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期交易单元无变更。

10.7.2 基金租用或者通过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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中银国际证券	78,598,094.96	30.01%	124,100,000.00	58.89%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	181,062,010.72	69.13%	86,620,000.00	41.11%	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券	2,246,276.57	0.86%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	江信一年定期开放债券型证券投资基金2025年第4季度报告	公司网站、证监会信息披露平台	2026-01-22
2	江信基金管理有限公司旗下全部基金2025年第四季度报告提示性公告	证券日报	2026-01-22
3	江信基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2026-02-03
4	江信基金管理有限公司关于江信一年定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2026-03-17
5	江信基金管理有限公司关于江信一年定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2026-03-18
6	江信基金管理有限公司关于江信一年定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2026-03-19
7	江信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2026-03-19
8	江信基金管理有限公司旗下	公司网站、证监会信息披露	2026-03-31

	公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	平台、证券日报	
9	江信一年定期开放债券型证券投资基金2025年年度报告	公司网站、证监会信息披露平台	2026-03-31
10	江信基金管理有限公司旗下全部基金2025年年度报告提示性公告	证券日报	2026-03-31
11	江信基金管理有限公司对外行使投票表决权（2025年度）情况信息披露	公司网站	2026-04-10
12	江信一年定期开放债券型证券投资基金2026年开放日常申购、赎回业务的公告	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2026-04-15
13	江信一年定期开放债券型证券投资基金2026年第1季度报告	公司网站、证监会信息披露平台	2026-04-21
14	江信基金管理有限公司旗下全部基金2026年第一季度报告提示性公告	证券日报	2026-04-21
15	江信基金管理有限公司关于江信一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告-20260423	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2026-04-23
16	江信一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书更新（2026年第1号）	公司网站、证监会信息披露平台	2026-04-23
17	江信一年定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新（2026年第1次）	公司网站、证监会信息披露平台	2026-04-23
18	江信一年定期开放债券型证券投资基金基金合同更新	公司网站、证监会信息披露平台	2026-04-23

§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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260630	24,919,646.37	-	-	24,919,646.37	99.21%
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

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、《江信一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；

2、《江信一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；

3、《江信一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件和营业执照；

5、基金托管人业务资格批件和营业执照；

6、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

二〇二六年八月三十一日