

江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金

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	8
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	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§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合规守信情况的说明	13
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	14
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	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 盈利投资者数量占比	54

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4 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	54
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	56
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	江信瑞福	
基金主代码	002630	
交易代码	002630	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年02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	638,612.14份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	江信瑞福A	江信瑞福C
下属分级基金的交易代码	002630	002631
报告期末下属分级基金的份额总额	291,859.46份	346,752.68份

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	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。
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B S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（A BS）、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。	
业绩比较基准	沪深300指数×50%+上证国债指数×50%。	
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。	
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于主动式混合	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。	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。
--	---	---

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1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		孙桢磬	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)	
	江信瑞福A	江信瑞福C
本期已实现收益	70,126.60	76,659.54
本期利润	82,223.18	99,347.97
加权平均基金份额本期利润	0.2676	0.2378
本期加权平均净值利润率	16.88%	16.10%
本期基金份额净值增长率	18.56%	18.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	江信瑞福A	江信瑞福C
期末可供分配利润	190,876.97	187,620.58
期末可供分配基金份额利润	0.6540	0.5411
期末基金资产净值	500,013.25	552,812.12
期末基金份额净值	1.7132	1.5943
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	江信瑞福A	江信瑞福C
基金份额累计净值增长率	71.32%	59.43%

- 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

江信瑞福A

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	15.91%	1.69%	6.20%	0.63%	9.71%	1.06%
过去六个月	18.56%	1.90%	4.53%	0.56%	14.03%	1.34%
过去一年	34.52%	1.42%	12.53%	0.50%	21.99%	0.92%
过去三年	45.42%	1.36%	20.55%	0.50%	24.87%	0.86%
过去五年	5.19%	1.38%	7.01%	0.53%	-1.82%	0.85%
过去七年	82.45%	1.31%	30.94%	0.58%	51.51%	0.73%
自基金合同 生效起至今	71.32%	1.29%	43.84%	0.58%	27.48%	0.71%

江信瑞福C

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	15.77%	1.69%	6.20%	0.63%	9.57%	1.06%
过去六个月	18.27%	1.90%	4.53%	0.56%	13.74%	1.34%
过去一年	33.84%	1.42%	12.53%	0.50%	21.31%	0.92%
过去三年	43.11%	1.36%	20.55%	0.50%	22.56%	0.86%
过去五年	2.49%	1.38%	7.01%	0.53%	-4.52%	0.85%
过去七年	77.24%	1.31%	30.94%	0.58%	46.30%	0.73%
自基金合同 生效起至今	59.43%	1.29%	43.84%	0.58%	15.59%	0.71%

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公司、鹰潭聚福投资管理有限公司。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		
高鹏飞	本基金的基金经理，权益投资总部总监	2020-10-26	-	12年	高鹏飞先生，硕士，CPA。曾任德勤会计师事务所审计师；投中资本分析师。2013年8月至2017年11月担任海通证券股份有限公司投资经理。2017年11月至2020年5月担任华夏久盈资产管理有限责任公司投资经理。2020年6月加入江信基金管理有限公司，任职于权益投

					资总部，现任权益投资总部总监，并担任江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、江信祺福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。
李悦	本基金基金经理助理	2024-03-11	-	4年	李悦，硕士研究生。2021年加入江信基金管理有限公司，现就职于权益投资总部。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《证券投资基金经营机构董事、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合规守信情况的说明

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

2026年上半年，中国经济总体延续温和复苏态势，GDP增速保持在合理区间。政策端，财政政策持续发力，专项债发行节奏前置，稳增长措施有序落地；货币政策保持稳健偏宽松，降准降息等操作灵活适度，流动性环境合理充裕。

需求端来看，消费市场稳步修复，服务消费表现亮眼，以旧换新等促消费政策效应持续释放。固定资产投资保持平稳增长，其中制造业投资和高技术产业投资增速较快，基建投资发挥稳增长托底作用，房地产投资降幅收窄、市场出现企稳迹象。出口方面，在全球贸易格局调整背景下保持韧性，但外需不确定性犹存。

价格方面，CPI温和回升，核心CPI逐步改善；PPI降幅持续收窄，工业品价格拐点渐显。就业形势总体稳定，城镇调查失业率保持平稳。总体而言，上半年经济呈现“波浪式发展、曲折式前进”的特征，结构性亮点突出但有效需求仍需进一步巩固。

上半年，本基金在产业景气度、预期实现度、拥挤度等维度动态调整行业配置。在个股选择方面以基本面因子为主轴，筛选营收、利润、ROE等有长期增长趋势的公司，并通过因子边际变化率来体现动量势能，继而结合估值和业绩预期来动态调整标的、最后参考量价等技术类指标形成最终持仓组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末江信瑞福A基金份额净值为1.7132元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为18.56%，同期业绩比较基准收益率为4.53%；截至报告期末江信瑞福C基金份额净值为1.5943元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为18.27%，同期业绩比较基准收益率为4.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，2026年下半年中国经济有望延续温和复苏态势。财政政策保持积极，货币政策稳健偏宽松，结构性工具持续支持实体经济。房地产与消费边际改善，新质生

产力相关投资保持较高增速。海外方面，全球增长动能边际放缓，美联储政策走向仍存不确定性，需关注外部环境对国内经济的影响。

证券市场方面，A股估值处于历史中枢偏低水平，中长期配置价值凸显。随着企业盈利边际改善与政策预期逐步落地，市场风险偏好有望修复，结构性机会值得关注。

行业方面，人工智能、高端制造等成长板块景气度有望延续；消费、医药板块具备修复空间；红利资产在低利率环境下仍具配置吸引力。

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，本基金报告期末未进行利润分配。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2024年1月30日至本报告期末，期间基金资产净值低于5000万元。本基金存在连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金管理人已按法规要求向中国证监会报送解决方案。

§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瑞福灵活配置混合型证券投资基金（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：江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金

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	586,284.69	287,336.26
结算备付金		1,336.37	28,105.42
存出保证金		1,372.95	1,344.93
交易性金融资产	6.4.7.2	497,365.00	739,927.78
其中：股票投资		497,365.00	456,718.00
基金投资		-	-
债券投资		-	283,209.78
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	-	199,924.44
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		853.85	42.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,087,212.86	1,256,680.83
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		24,549.62	114,115.48
应付赎回款		6,292.40	4,856.66
应付管理人报酬		583.13	656.97
应付托管费		124.94	140.81
应付销售服务费		226.84	250.20

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,610.56	8,124.65
负债合计		34,387.49	128,144.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	638,612.14	811,643.89
未分配利润	6.4.7.8	414,213.23	316,892.17
净资产合计		1,052,825.37	1,128,536.06
负债和净资产总计		1,087,212.86	1,256,680.83

报告截止日2026年6月30日，基金份额总额638,612.14份。

其中A类基金份额的份额总额291,859.46份，A类基金份额的份额净值1.7132元；C类基金份额的份额总额346,752.68份，C类基金份额的份额净值1.5943元。

6.2 利润表

会计主体：江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金

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202 5年06月30日
一、营业总收入		187,762.87	-55,764.87
1.利息收入		799.72	3,266.49
其中：存款利息收入	6.4.7.9	546.91	3,266.49
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		252.81	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		148,677.18	-52,601.92

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	164,656.87	-67,256.42
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-18,140.29	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
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	2,160.60	14,654.50
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	34,785.01	-10,207.78
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	3,500.96	3,778.34
减：二、营业总支出		6,191.72	23,312.50
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,835.64	5,097.46
2.托管费	6.4.10.2.2	821.87	1,092.36
3.销售服务费	6.4.10.2.3	1,534.21	1,715.17
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.20	-	15,407.51
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		181,571.15	-79,077.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		181,571.15	-79,077.37

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		181,571.15	-79,077.37

6.3 净资产变动表

会计主体：江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金

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	811,643.89	316,892.17	1,128,536.06
二、本期期初净资产	811,643.89	316,892.17	1,128,536.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-173,031.75	97,321.06	-75,710.69
（一）、综合收益总额	-	181,571.15	181,571.15
（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）	-173,031.75	-84,250.09	-257,281.84
其中：1.基金申购款	619,541.76	330,259.27	949,801.03
2.基金赎回款	-792,573.51	-414,509.36	-1,207,082.87
（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	638,612.14	414,213.23	1,052,825.37
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	1,687,611.22	484,534.02	2,172,145.24
二、本期期初净资产	1,687,611.22	484,534.02	2,172,145.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-751,791.52	-272,994.82	-1,024,786.34
（一）、综合收益总额	-	-79,077.37	-79,077.37
（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）	-751,791.52	-193,917.45	-945,708.97
其中：1.基金申购款	354,880.13	81,249.72	436,129.85
2.基金赎回款	-1,106,671.65	-275,167.17	-1,381,838.82
（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	935,819.70	211,539.20	1,147,358.90

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

江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]2106号文《关于准予江信瑞福灵活配置混合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《江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责在2016年11月15日至2017年2月14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002630,基金简称为“江信瑞福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002631,基金简称为“江信瑞福C”。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集,江信瑞福A不包括认购资金利息共募集415,051.09元,江信瑞福C不包括认购资金利息共募集203,614,928.00元,合计204,029,979.09元,已经大华会计师事务所(特殊普通合伙)大华验字[2017]000086号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年2月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为204,037,339.28份基金份额,其中认购资金利息折合7,360.19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%,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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×50%+上证国债指数×50%。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	586,284.69
等于：本金	586,223.83
加：应计利息	60.86
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	586,284.69

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	474,650.00	-	497,365.00	22,715.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	-	-	-	-

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		474,650.00	-	497,365.00	22,715.00

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	2,610.56
其中：交易所市场	2,610.56
银行间市场	-
应付利息	-
合计	2,610.56

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 江信瑞福A

金额单位：人民币元

项目 (江信瑞福A)	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	355,083.36	355,083.36
本期申购	180,184.66	180,184.66
本期赎回（以“-”号填列）	-243,408.56	-243,408.56
本期末	291,859.46	291,859.46

6.4.7.7.2 江信瑞福C

金额单位：人民币元

项目 (江信瑞福C)	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	456,560.53	456,560.53
本期申购	439,357.10	439,357.10
本期赎回（以“-”号填列）	-549,164.95	-549,164.95
本期末	346,752.68	346,752.68

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

6.4.7.8.1 江信瑞福A

单位：人民币元

项目 (江信瑞福A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	156,654.93	1,351.71	158,006.64
本期期初	156,654.93	1,351.71	158,006.64
本期利润	70,126.60	12,096.58	82,223.18
本期基金份额交易产生的变动数	-35,904.56	3,828.53	-32,076.03

其中：基金申购款	103,575.83	8,212.12	111,787.95
基金赎回款	-139,480.39	-4,383.59	-143,863.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	190,876.97	17,276.82	208,153.79

6.4.7.8.2 江信瑞福C

单位：人民币元

项目 (江信瑞福C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	158,122.49	763.04	158,885.53
本期期初	158,122.49	763.04	158,885.53
本期利润	76,659.54	22,688.43	99,347.97
本期基金份额交易产生的变动数	-47,161.45	-5,012.61	-52,174.06
其中：基金申购款	213,994.50	4,476.82	218,471.32
基金赎回款	-261,155.95	-9,489.43	-270,645.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	187,620.58	18,438.86	206,059.44

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	525.57
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	18.92
其他	2.42
合计	546.91

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	2,942,279.63
减：卖出股票成本总额	2,773,173.01
减：交易费用	4,449.75
买卖股票差价收入	164,656.87

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	108.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-18,249.00
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	-18,140.29

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	280,994.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑	298,265.00

付) 成本总额	
减: 应计利息总额	978.49
减: 交易费用	-
买卖债券差价收入	-18,249.00

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,160.60
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,160.60

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	34,785.01
——股票投资	18,860.01

——债券投资	15,925.00
——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	34,785.01

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	3,500.96
合计	3,500.96

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

本基金管理人主动承担了本基金自2025年1月1日起的信息披露费、审计费、银行间账户维护费等固定费用。

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	中国光大银行股份有限公司

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

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	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国盛证券股份有限公司	2,797,105.28	48.75%	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	6,100,231.60	35.61%

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	280,016.00	100.00%	-	-

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 股份有限 公司	2,750,000.00	100.00%	-	-

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

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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国盛证券股份有限公司	1,303.17	49.92%	1,303.17	49.92%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国盛证券有限责任公司	2,841.94	49.30%	2,841.94	49.30%

（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关规定。根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,835.64	5,097.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,768.98	2,078.97
应支付基金管理人的净管理费	2,066.66	3,018.49

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：

$H=E\times 0.70\%\div \text{当年天数}$

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

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	821.87	1,092.36

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 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		
	江信瑞福A	江信瑞福C	合计

国盛证券 股份有限 公司	0.00	0.00	0.00
中国光大 银行股份 有限公司	0.00	10.38	10.38
江信基金 管理有限 公司	0.00	0.45	0.45
合计	0.00	10.83	10.83
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		
	江信瑞福A	江信瑞福C	合计
国盛证券 有限责任 公司	0.00	0.00	0.00
中国光大 银行股份 有限公司	0.00	29.39	29.39
江信基金 管理有限 公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	29.39	29.39

注：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。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

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		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		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	586,284.69	525.57	111,160.22	3,231.82

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

本基金是一只混合型证券投资基金。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。

本报告期末，本基金未持有债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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

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。本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券投资。

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0	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
---------------	------	------	------	-----	----

6月30日					
资产					
货币资金	586,284.69	-	-	-	586,284.69
结算备付金	1,326.37	-	-	10.00	1,336.37
存出保证金	1,372.95	-	-	-	1,372.95
交易性金融资产	-	-	-	497,365.00	497,365.00
应收申购款	-	-	-	853.85	853.85
资产总计	588,984.01	-	-	498,228.85	1,087,212.86
负债					
应付清算款	-	-	-	24,549.62	24,549.62
应付赎回款	-	-	-	6,292.40	6,292.40
应付管理人报酬	-	-	-	583.13	583.13
应付托管费	-	-	-	124.94	124.94
应付销售服务费	-	-	-	226.84	226.84
其他负债	-	-	-	2,610.56	2,610.56
负债总计	-	-	-	34,387.49	34,387.49
利率敏感度缺口	588,984.01	-	-	463,841.36	1,052,825.37
上年度	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

末 2025年1 2月31日					
资产					
货币资 金	287,336.26	-	-	-	287,336.26
结算备 付金	28,095.42	-	-	10.00	28,105.42
存出保 证金	1,344.93	-	-	-	1,344.93
交易性 金融资 产	-	-	283,209.78	456,718.00	739,927.78
买入返 售金融 资产	199,924.44	-	-	-	199,924.44
应收申 购款	-	-	-	42.00	42.00
资产总 计	516,701.05	-	283,209.78	456,770.00	1,256,680.83
负债					
应付清 算款	-	-	-	114,115.48	114,115.48
应付赎 回款	-	-	-	4,856.66	4,856.66
应付管 理人报 酬	-	-	-	656.97	656.97
应付托 管费	-	-	-	140.81	140.81
应付销 售服务 费	-	-	-	250.20	250.20
其他负 债	-	-	-	8,124.65	8,124.65
负债总 计	-	-	-	128,144.77	128,144.77

利率敏感度缺口	516,701.05	-	283,209.78	328,625.23	1,128,536.06
---------	------------	---	------------	------------	--------------

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	0.00	-11,906.41
	市场利率下降25.00bp	0.00	12,634.37

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025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	497,365.00	47.24	456,718.00	40.47
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	497,365.00	47.24	456,718.00	40.47

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%		
	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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	权益性投资的市场价格上升5%	24,868.25	22,835.90
	权益性投资的市场价格下	-24,868.25	-22,835.90

	降5%		
--	-----	--	--

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	497,365.00	456,718.00
第二层次	-	283,209.78
第三层次	-	-
合计	497,365.00	739,927.78

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	497,365.00	45.75
	其中：股票	497,365.00	45.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	587,621.06	54.05
8	其他各项资产	2,226.80	0.20
9	合计	1,087,212.86	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	50,256.00	4.77
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	447,109.00	42.47
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	497,365.00	47.24

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

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300033	同花顺	200	48,200.00	4.58

2	601211	国泰海通	2,000	36,400.00	3.46
3	601377	兴业证券	6,000	36,240.00	3.44
4	601336	新华保险	600	35,796.00	3.40
5	601066	中信建投	1,200	34,884.00	3.31
6	601688	华泰证券	1,500	30,930.00	2.94
7	600498	烽火通信	400	29,440.00	2.80
8	600030	中信证券	1,000	28,730.00	2.73
9	601318	中国平安	600	28,644.00	2.72
10	601601	中国太保	1,000	28,520.00	2.71
11	601108	财通证券	3,000	25,950.00	2.46
12	000776	广发证券	1,100	25,740.00	2.44
13	600999	招商证券	1,200	25,320.00	2.40
14	601995	中金公司	600	21,690.00	2.06
15	601628	中国人寿	600	21,210.00	2.01
16	600276	恒瑞医药	400	20,816.00	1.98
17	601881	中国银河	1,500	18,855.00	1.79

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	600498	烽火通信	91,422.00	8.10
2	688313	仕佳光子	66,872.00	5.93
3	002865	钧达股份	62,652.00	5.55
4	688668	鼎通科技	58,600.00	5.19
5	688411	海博思创	58,000.00	5.14
6	688568	中科星图	54,938.00	4.87
7	688037	芯源微	53,000.00	4.70
8	300762	上海瀚讯	51,921.00	4.60

9	688702	盛科通信	51,600.00	4.57
10	688418	震有科技	50,618.00	4.49
11	688235	百济神州	49,000.00	4.34
12	300033	同花顺	46,130.00	4.09
13	688333	铂力特	46,080.00	4.08
14	688295	中复神鹰	45,854.00	4.06
15	301232	飞沃科技	40,700.00	3.61
16	600343	航天动力	39,581.00	3.51
17	300136	信维通信	39,070.00	3.46
18	600183	生益科技	37,600.00	3.33
19	601377	兴业证券	36,900.00	3.27
20	605598	上海港湾	36,444.00	3.23
21	601211	国泰海通	36,180.00	3.21
22	002544	普天科技	35,975.00	3.19
23	300342	天银机电	34,572.00	3.06
24	601336	新华保险	34,320.00	3.04
25	688301	奕瑞科技	33,464.00	2.97
26	600850	电科数字	33,116.00	2.93
27	600276	恒瑞医药	33,048.00	2.93
28	688270	ST臻镭	32,400.00	2.87
29	601318	中国平安	31,792.00	2.82
30	601066	中信建投	31,124.00	2.76
31	002465	海格通信	30,985.00	2.75
32	688385	复旦微电	30,400.00	2.69
33	601601	中国太保	30,355.00	2.69
34	688372	伟测科技	30,280.00	2.68
35	600879	航天电子	29,790.00	2.64
36	600118	中国卫星	29,546.00	2.62
37	601688	华泰证券	28,880.00	2.56
38	688521	芯原股份	28,846.00	2.56
39	688066	*ST航图	27,216.00	2.41

40	605090	九丰能源	26,501.00	2.35
41	688271	联影医疗	25,854.00	2.29
42	301230	泓博医药	25,739.00	2.28
43	600030	中信证券	25,504.00	2.26
44	688239	航宇科技	25,300.00	2.24
45	300455	航天智装	25,272.00	2.24
46	603131	上海沪工	24,198.00	2.14
47	601108	财通证券	24,180.00	2.14
48	688375	国博电子	24,000.00	2.13
49	300953	震裕科技	23,800.00	2.11

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600498	烽火通信	95,067.00	8.42
2	688521	芯原股份	81,358.00	7.21
3	688691	灿芯股份	80,346.27	7.12
4	688668	鼎通科技	75,448.00	6.69
5	002865	钧达股份	73,789.00	6.54
6	688313	仕佳光子	70,446.00	6.24
7	688615	合合信息	66,715.03	5.91
8	688506	百利天恒	66,400.00	5.88
9	688702	盛科通信	62,382.00	5.53
10	688037	芯源微	56,916.00	5.04
11	300136	信维通信	56,387.00	5.00
12	688411	海博思创	55,354.00	4.90
13	300762	上海瀚讯	53,518.00	4.74
14	688235	百济神州	51,000.00	4.52
15	688418	震有科技	50,827.16	4.50

16	688295	中复神鹰	49,647.00	4.40
17	301230	泓博医药	45,188.00	4.00
18	300342	天银机电	42,618.00	3.78
19	688568	中科星图	41,954.00	3.72
20	600343	航天动力	39,096.00	3.46
21	301232	飞沃科技	37,161.00	3.29
22	600183	生益科技	36,002.00	3.19
23	688277	天智航	34,400.00	3.05
24	688301	奕瑞科技	34,020.00	3.01
25	605598	上海港湾	33,643.00	2.98
26	688131	皓元医药	33,616.00	2.98
27	688333	铂力特	32,968.00	2.92
28	002149	西部材料	32,167.00	2.85
29	600276	恒瑞医药	31,878.00	2.82
30	600176	中国巨石	31,838.00	2.82
31	301306	西测测试	30,800.00	2.73
32	688270	ST臻镭	30,400.00	2.69
33	600118	中国卫星	30,052.00	2.66
34	688372	伟测科技	28,854.00	2.56
35	688239	航宇科技	28,200.00	2.50
36	600879	航天电子	28,144.00	2.49
37	002465	海格通信	27,984.00	2.48
38	002544	普天科技	26,886.00	2.38
39	600850	电科数字	26,414.00	2.34
40	688385	复旦微电	25,762.00	2.28
41	688066	*ST航图	23,556.00	2.09
42	605090	九丰能源	22,895.00	2.03
43	300604	长川科技	22,800.00	2.02
44	300953	震裕科技	22,750.00	2.02

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,794,960.00
卖出股票收入（成交）总额	2,942,279.63

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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其他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）本基金持有的国泰海通（代码：601211.SH）的发行主体国泰海通证券股份有限公司于2026年3月2日被中国证券监督管理委员会上海监管局采取出具警示函的监督管理措施（沪证监决〔2026〕65号）；于2026年4月3日被中国证券监督管理委员会上海监管局采取出具警示函的监督管理措施（沪证监决〔2026〕112号）。

（2）本基金持有的中信建投（代码：601066.SH）的发行主体中信建投证券股份有限公司于2025年9月23日被中国证券监督管理委员会福建监管局采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案（中国证券监督管理委员会福建监管局行政监管措施决定书〔2025〕69号）；于2026年4月30日被中国证监会北京监管局采取监管谈话的行政监管措施。

7.12.2 本基金本报告期末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	1,372.95
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	853.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,226.80

7.12.4 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。

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

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 瑞福A	284	1,027.67	0.00	0.00%	291,859.46	100.00%
江信 瑞福C	263	1,318.45	0.00	0.00%	346,752.68	100.00%
合计	547	1,167.48	0.00	0.00%	638,612.14	100.00%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	89.07%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 （份）	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持 有本基金	江信瑞福A	-	-
	江信瑞福C	-	-
	合计	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式	江信瑞福A	0
	江信瑞福C	0

基金	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	江信瑞福A	0
	江信瑞福C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	江信瑞福A	江信瑞福C
基金合同生效日(2017年02月17日)基金份额总额	415,373.73	203,621,965.55
本报告期期初基金份额总额	355,083.36	456,560.53
本报告期基金总申购份额	180,184.66	439,357.10
减：本报告期基金总赎回份额	243,408.56	549,164.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	291,859.46	346,752.68

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金无基金份额持有人大会决议。

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	1,959,657.35	34.16%	893.37	34.22%	-
国金证券	2	126,516.00	2.21%	24.77	0.95%	-
国盛证券	2	2,797,105.28	48.75%	1,303.17	49.92%	-
金融街证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	853,961.00	14.88%	389.25	14.91%	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	280,016.00	100.00%	2,750,000.00	100.00%	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金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
5	江信基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2026-03-31

6	江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金2025年年度报告	公司网站、证监会信息披露平台	2026-03-31
7	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
8	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
9	江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金2026年第1季度报告	公司网站、证监会信息披露平台	2026-04-21
10	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
11	江信瑞福灵活配置混合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	2026-05-09
12	江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额	公司网站、证监会信息披露平台	2026-05-09
13	江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额	公司网站、证监会信息披露平台	2026-05-09

§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

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、《江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《江信瑞福灵活配置混合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