

# 江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 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:2023 年 08 月 30 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，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2023年08月29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2023年01月01日起至2023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合规守信情况的说明              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 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             | 11 |
| 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                 | 12 |
| 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       | 12 |
| §5 托管人报告                                | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 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       | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 13 |
| 6.1 资产负债表                               | 13 |
| 6.2 利润表                                 | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 16 |
| 6.4 报表附注                                | 18 |
| §7 投资组合报告                               | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 36 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 37 |
| 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      | 38 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 38 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 38 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 38 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 38 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 38 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 40 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 40 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 40 |

|  |    |
|--|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....   | 40 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                | 40 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                       | 40 |
| §10 重大事件揭示 .....                         | 41 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 41 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 41 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 41 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 41 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 41 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 41 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 42 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 42 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 43 |
| 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 ..... | 43 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 43 |
| §12 备查文件目录 .....                         | 44 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 44 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 44 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 44 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 江信聚福                 |
| 基金主代码      | 000583               |
| 交易代码       | 000583               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2014年05月29日          |
| 基金管理人      | 江信基金管理有限公司           |
| 基金托管人      | 中国光大银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 72,636,623.57份       |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 在有效控制风险的基础上，通过主动管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益。  |
| 投资策略 | <p>由于本基金存在开放期与封闭期，在开放期与封闭期将实行不同的投资策略。</p> <p>在开放期内本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。在封闭期内的投资将依托基金管理人自身信用评级体系和信用风险控制措施。采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，实现风险和收益的最佳配比。</p> <p>本基金在封闭期内债券投资策略如下：</p> <p>1、债券类属配置策略</p> <p>根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定债券类属配置策略，并根据市场变化及时进行调整，从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。</p> <p>2、久期管理策略</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。</p> <p>3、收益率曲线策略</p> <p>在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。</p> <p>4、信用债券投资策略</p> <p>本基金将主要通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品，获取票息收益。此外，本基金还将通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断，主动采用信用利差投资策略，获取利差收益。</p> <p>5、本基金对可转换公司债券、资产支持债券等特殊固定收益品种，将利用数量模型，对在其进行充分的定价评估的基础上进行投资。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>同期中国人民银行公布的6个月期定期存款基准利率（税后）+1.7%。本基金的业绩比较基准将在每一封闭期的第一个工作日，根据中国人民银行公布的金融机构人民币利率进行最新调整。</p>  |
| 风险收益特征 | <p>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。</p>  |

### 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   | 原亮                         | 石立平                       |
|         | 联系电话 | 010-57380891               | 010-63639180              |
|         | 电子邮箱 | customer@jxfund.cn         | shiliping@cebbank.com     |
| 客户服务电话  |      | 400-622-0583               | 95595                     |
| 传真      |      | 010-57380988               | 010-63639132              |
| 注册地址    |      | 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  | 北京市海淀区华熙LIVE中心<br>11号楼B座3层 | 北京市西城区太平桥大街25<br>号中国光大中心 |
| 邮政编码  | 100039                     | 100033                   |
| 法定代表人 | 孙楨磬                        | 王江                       |

## 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》                     |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.jxfund.cn              |
| 基金中期报告备置地点          | 北京市海淀区华熙LIVE中心11号<br>楼B座3层 |

## 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<br>公司 | 北京市西城区太平桥大街17号 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期<br>(2023年01月01日-2023年06月30日) |
|---------------|----------------------------------|
|               | 本期已实现收益                          |
| 本期利润          | 2,626,010.35                     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0350                           |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.87%                            |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.91%                            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2023年06月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 11,924,263.48                    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1642                           |
| 期末基金资产净值      | 89,530,101.73                    |

|                     |                       |
|---------------------|-----------------------|
| 期末基金份额净值            | 1.2325                |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | 报告期末<br>(2023年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率         | 69.98%                |

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         | 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      | 0.18%    | 0.04%       | 0.21%      | 0.01%         | -0.03% | 0.03% |
| 过去三个月      | 1.07%    | 0.04%       | 0.64%      | 0.01%         | 0.43%  | 0.03% |
| 过去六个月      | 2.91%    | 0.04%       | 1.28%      | 0.01%         | 1.63%  | 0.03% |
| 过去一年       | 5.31%    | 0.05%       | 2.61%      | 0.01%         | 2.70%  | 0.04% |
| 过去三年       | 15.77%   | 0.08%       | 8.25%      | 0.01%         | 7.52%  | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 69.98%   | 0.12%       | 32.03%     | 0.01%         | 37.95% | 0.11% |

### 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



江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2014年05月29日-2023年06月30日)



## §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、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2023年06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、江信增利货币市场基金。同时，公司还管理着多个资产管理计划。

#### 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 | 证券 | 说明 |
|----|----|--------|----|----|
|----|----|--------|----|----|

|         |                                    | 金经理(助理)<br>期限  |                | 从业<br>年限 |   |
|---------|------------------------------------|----------------|----------------|----------|---|
|         |                                    | 任职<br>日期       | 离任<br>日期       |          |   |
| 马超<br>然 | 本基金的基金<br>经理                       | 2023-<br>06-29 | -              | 9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，任职于固定收益总部。现任江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、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基金经理。 |
| 静鹏      | 本基金的基金<br>经理，固定收<br>益公募投资总<br>部副总监 | 2019-<br>03-18 | 2023-<br>06-29 | 11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，现任江信基金固定收益公募投资总部副总监，江信祺福债券型证券投资基金基金经理。  |

注：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

#### 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》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，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

上半年的债券市场走出一个小牛市，虽然在半年末降息后迎来止盈的压力，但是由于较为宽松的资金环境，使得债券市场仍旧保持大趋势不变。但是对于新的资金来说，较低的利率水平使得再配置压力很大。

报告期内，管理人根据债券市场运行情况积极调整债券投资策略，在兼顾投资组合的流动性和收益性条件下，维持稳定的杠杆比例

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末江信聚福基金份额净值为1.2325元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.91%，同期业绩比较基准收益率为1.28%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年的宏观数据实现了年初既定的GDP增长目标，因此逆周期的调节政策也有较强的定力。

展望未来，市场预期在不断变化，但是经济复苏脚步平稳，政策定力强，预计整体流动性继续维持目前宽松格局。

根据目前的宏观经济情况来看，进一步的大规模刺激政策可能性较低。在上半年债牛之后，债券市场中周期的力量，回归中枢的驱动力将占据上风，好消息可能已经被充

分定价，价格对坏消息的敏感程度显著上升。但是在利率总体下行的大趋势中，利率脉冲式的短期上行是配置的时间窗口，值得好好把握。

#### 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

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金（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、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依法对基金管理人编制的《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金2023年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 949,721.34         | 140,379.15          |
| 结算备付金      |         | 611,597.29         | 689,797.72          |
| 存出保证金      |         | 8,368.71           | 3,790.10            |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 69,339,933.84      | 81,413,948.49       |
| 其中：股票投资    |         | -                  | -                   |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | 69,339,933.84      | 81,413,948.49       |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 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    | 49,954,571.11              | 55,640,407.55               |
| 债权投资          |            | -                          | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                          | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | -                          | 488,541.82                  |
| 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          |            | 120,864,192.29             | 138,376,864.83              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2022年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | 31,206,140.07              | 46,337,260.50               |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 40,278.74                  | 40,086.53                   |
| 应付托管费         |            | 6,713.11                   | 6,681.10                    |
| 应付销售服务费       |            | -                          | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 797.98                     | 2,575.46                    |

|             |         |                |                |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 应付利润        |         | -              | -              |
| 递延所得税负债     |         | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 80,160.66      | 81,684.49      |
| 负债合计        |         | 31,334,090.56  | 46,468,288.08  |
| <b>净资产：</b> |         |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 72,636,623.57  | 76,738,615.54  |
| 其他综合收益      |         | -              | -              |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 16,893,478.16  | 15,169,961.21  |
| 净资产合计       |         | 89,530,101.73  | 91,908,576.75  |
| 负债和净资产总计    |         | 120,864,192.29 | 138,376,864.83 |

## 6.2 利润表

会计主体：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2023年01月01<br>日至2023年06<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至<br>2022年06月30日 |
|------------------|----------|---------------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | 3,368,603.18                          | 1,777,524.78                           |
| 1.利息收入           |          | 1,121,123.28                          | 1,038,906.98                           |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 20,508.75                             | 7,296.78                               |
| 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       |          | 1,100,614.53                          | 1,031,610.20                           |
| 其他利息收入           |          | -                                     | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 2,094,734.22                          | 738,651.62                             |
| 其中：股票投资收益        |          | -                                     | -                                      |
| 基金投资收益           |          | -                                     | -                                      |
| 债券投资收益           | 6.4.7.10 | 2,094,734.22                          | 738,651.62                             |
| 资产支持证券投资收益       | 6.4.7.11 | -                                     | -                                      |

|                            |            |              |              |
|----------------------------|------------|--------------|--------------|
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.12   | -            | -            |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.13   | -            | -            |
| 股利收益                       | 6.4.7.14   | -            | -            |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -            | -            |
| 其他投资收益                     |            | -            | -            |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.15   | 152,715.08   | -33.82       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -            | -            |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.16   | 30.60        | -            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 742,592.83   | 488,434.31   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 271,858.36   | 149,673.76   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 45,309.71    | 32,497.09    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -            | -            |
| 4. 投资顾问费                   |            | -            | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 324,542.04   | 247,814.27   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 324,542.04   | 247,814.27   |
| 6. 信用减值损失                  |            | -            | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 2,939.56     | 177.61       |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.17   | 97,943.16    | 58,271.58    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 2,626,010.35 | 1,289,090.47 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 2,626,010.35 | 1,289,090.47 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -            | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 2,626,010.35 | 1,289,090.47 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元



| 项目                                       | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日      |        |                |                |
|--|------------------------------------|--------|----------------|----------------|
|  | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 76,738,615.54                      | -      | 15,169,961.21  | 91,908,576.75  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                  | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                  | -      | -              | -              |
| 其他                                       | -                                  | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 76,738,615.54                      | -      | 15,169,961.21  | 91,908,576.75  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -4,101,991.97                      | -      | 1,723,516.95   | -2,378,475.02  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | -      | 2,626,010.35   | 2,626,010.35   |
| （二）、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）      | -4,101,991.97                      | -      | -902,493.40    | -5,004,485.37  |
| 其中：1.基金申购款                               | 60,121,856.86                      | -      | 13,776,447.55  | 73,898,304.41  |
| 2.基金赎回款                                  | -64,223,848.83                     | -      | -14,678,940.95 | -78,902,789.78 |
| （三）、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） | -                                  | -      | -              | -              |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                  | -      | -              | -              |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 72,636,623.57                      | -      | 16,893,478.16  | 89,530,101.73  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |        |                |                |
|  | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |

|  |                |   |               |                |
|--|----------------|---|---------------|----------------|
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 44,542,237.37  | - | 6,260,360.26  | 50,802,597.63  |
| 加：会计政策变更                                 | -              | - | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -              | - | -             | -              |
| 其他                                       | -              | - | -             | -              |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 44,542,237.37  | - | 6,260,360.26  | 50,802,597.63  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -186,508.75    | - | 1,300,733.41  | 1,114,224.66   |
| （一）、综合收益总额                               | -              | - | 1,289,090.47  | 1,289,090.47   |
| （二）、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）      | -186,508.75    | - | 11,642.94     | -174,865.81    |
| 其中：1.基金申购款                               | 13,174,733.03  | - | 2,211,386.35  | 15,386,119.38  |
| 2.基金赎回款                                  | -13,361,241.78 | - | -2,199,743.41 | -15,560,985.19 |
| （三）、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） | -              | - | -             | -              |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -              | - | -             | -              |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 44,355,728.62  | - | 7,561,093.67  | 51,916,822.29  |

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：

焦毛

付明

刘健菲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2014]242号文《关于核准江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金募集的批复》核准，由江信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，定期开放申购和赎回，首次设立募集不包括认购资金利息共募集198,785,738.43元，已经大华会计师事务所（特殊普通合伙）大华验字[2014]000182号验资报告予以验证。经中国证监会备案，《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2014年5月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为198,839,914.33份基金份额，其中认购资金利息折合54,175.90份基金份额。本基金的基金管理人为江信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的国债、中央银行票据、政策性金融债券、商业银行金融债券、商业银行次级债、短期融资券、地方政府债券、企业债券、公司债券、中小企业私募债、可转换公司债券（含可分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购、中期票据、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接买入股票、权证等权益类资产，但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资可分离交易可转债而产生的权证等。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于80%，权益类资产占基金资产的比例不超过20%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，本基金不受前述比例限制。开放期内本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券资产占基金资产净值的比例不低于5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等（在封闭期内，本基金不受此限制）。

本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的6个月期定期存款基准利率（税后）+1.7%。本基金的业绩比较基准将在每一封闭期的第一个工作日，根据中国人民银行公布的金融机构人民币利率进行最新调整。

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2023年08月30日批准报出。

#### 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、

《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年01月01日至2023年06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2023年06月30日的财务状况以及2023年01月01日至2023年06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需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[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，主要税项列示如下：

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末         |  |
|--------------|-------------|--|
|              | 2023年06月30日 |  |
| 活期存款         | 949,721.34  |  |
| 等于：本金        | 947,921.34  |  |
| 加：应计利息       | 1,800.00    |  |
| 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           | 949,721.34  |  |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末         |      |      |        |
|----|-------------|------|------|--------|
|    | 2023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         | 66,677,620.06 | 517,319.63    | 67,305,802.33 | 110,862.64 |
|               | 银行间市场         | 2,000,000.00  | 41,731.51     | 2,034,131.51  | -7,600.00  |
|               | 合计            | 68,677,620.06 | 559,051.14    | 69,339,933.84 | 103,262.64 |
| 资产支持证券        | -             | -             | -             | -             |            |
| 基金            | -             | -             | -             | -             |            |
| 其他            | -             | -             | -             | -             |            |
| 合计            | 68,677,620.06 | 559,051.14    | 69,339,933.84 | 103,262.64    |            |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2023年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 49,954,571.11      | -         |
| 银行间市场 | -                  | -         |
| 合计    | 49,954,571.11      | -         |

##### 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 |
|----|-----|
|----|-----|

|             | 2023年06月30日 |
|-------------|-------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -           |
| 应付赎回费       | -           |
| 应付交易费用      | 817.50      |
| 其中：交易所市场    | -           |
| 银行间市场       | 817.50      |
| 应付利息        | -           |
| 预提费用        | 79,343.16   |
| 合计          | 80,160.66   |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                |
|---------------|-------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末          | 76,738,615.54                 | 76,738,615.54  |
| 本期申购          | 60,121,856.86                 | 60,121,856.86  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -64,223,848.83                | -64,223,848.83 |
| 本期末           | 72,636,623.57                 | 72,636,623.57  |

#### 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        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期期初           | 10,069,561.56  | 5,100,399.65  | 15,169,961.21  |
| 本期利润           | 2,473,295.27   | 152,715.08    | 2,626,010.35   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -618,593.35    | -283,900.05   | -902,493.40    |
| 其中：基金申购款       | 9,699,558.52   | 4,076,889.03  | 13,776,447.55  |
| 基金赎回款          | -10,318,151.87 | -4,360,789.08 | -14,678,940.95 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 11,924,263.48  | 4,969,214.68  | 16,893,478.16  |

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期                      |
|-----------|-------------------------|
|           | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 活期存款利息收入  | 14,357.66               |
| 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 | 6,106.86                |
| 其他        | 44.23                   |
| 合计        | 20,508.75               |

**6.4.7.10 债券投资收益****6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                          |
|------------------------------|-----------------------------|
|                              | 2023年01月01日至<br>2023年06月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,369,238.52                |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 725,495.70                  |
| 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                           | 2,094,734.22                |

**6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                          |
|------------------------|-----------------------------|
|                        | 2023年01月01日至<br>2023年06月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 137,734,755.54              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 134,697,834.70              |
| 减：应计利息总额               | 2,308,373.68                |
| 减：交易费用                 | 3,051.46                    |



|          |            |
|----------|------------|
| 买卖债券差价收入 | 725,495.70 |
|----------|------------|

#### 6.4.7.11 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。

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

##### 6.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

本期本基金无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.12.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本期本基金无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.12.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本期本基金无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.12.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本期本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 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。

##### 6.4.7.13.2 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。

#### 6.4.7.14 股利收益

本期本基金无股利收益。

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称      | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 152,715.08                    |
| ——股票投资    | -                             |

|                             |            |
|-----------------------------|------------|
| ——债券投资                      | 152,715.08 |
| ——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<br>的预估增值税 | -          |
| 合计                          | 152,715.08 |

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 30.60                   |
| 合计      | 30.60                   |

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                      |
|-------|-------------------------|
|       | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 审计费用  | 39,671.58               |
| 信息披露费 | 39,671.58               |
| 帐户维护费 | 18,000.00               |
| 其他费用  | 600.00                  |
| 合计    | 97,943.16               |

### 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

截至财务报表批准报出日，发生以下日后事项：

2023年7月1日，本公司变更办公地址为北京市海淀区华熙LIVE中心11号楼B座3层。

### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 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   | 本基金管理人股东     |
| 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、基金销售机构 |

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。

### 6.4.10 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

本期及去年同期，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 应支付关联方的佣金

本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<br>2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 271,858.36                    | 149,673.76                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 31,377.11                     | 6,239.33                           |

基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提，基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
|                | 2023年01月01日至2023年06月30日 | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 45,309.71               | 32,497.09               |

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：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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                      |
|----------------|-------------------------|
|                | 2023年01月01日至2023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     | 0.00                    |
| 中国光大银行股份有限公司   | 0.00                    |
| 江信基金管理有限公司     | 0.00                    |
| 合计             | 0.00                    |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                 |
|                | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |
| 合计             | 0.00                    |

#### 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

份额单位：份

| 项目                  | 本期                          | 上年度可比期间                     |
|---------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                     | 2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 2022年01月01日至<br>2022年06月30日 |
| 报告期初持有的基金份额         | 0.00                        | 14,763,555.85               |
| 报告期间申购/买入总份额        | 0.00                        | 0.00                        |
| 报告期间因拆分变动份额         | 0.00                        | 0.00                        |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | 0.00                        | 0.00                        |
| 报告期末持有的基金份额         | 0.00                        | 14,763,555.85               |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00%                       | 33.28%                      |

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                      |           | 上年度可比期间                 |          |
|--------------|-------------------------|-----------|-------------------------|----------|
|              | 2023年01月01日至2023年06月30日 |           | 2022年01月01日至2022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 | 949,721.34              | 14,357.66 | 197,869.42              | 4,473.12 |

本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，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（2023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，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023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31,206,140.07元，于2023年7月12日、7月19日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，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2023年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为7.30%。

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<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00               | -                   |
| A-1以下  | 0.00               | -                   |
| 未评级    | 2,034,131.51       | -                   |
| 合计     | 2,034,131.51       | -                   |

#### 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<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 4,505,506.43       | 13,059,954.29       |
| AAA以下  | 0.00               | 22,380,448.99       |
| 未评级    | 0.00               | 0.00                |
| 合计     | 4,505,506.43       | 35,440,403.28       |

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

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发行的证券不得超过该证券的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。

截至本报告期末，除卖出回购金融资产款余额中有31,200,000.00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<br>2023 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                     | 949,721.34     | -             | -          | -           | 949,721.34     |
| 结算备付金                    | 611,597.29     | -             | -          | -           | 611,597.29     |
| 存出保证金                    | 8,368.71       | -             | -          | -           | 8,368.71       |
| 交易性金融资产                  | 64,834,427.41  | 4,505,506.43  | -          | -           | 69,339,933.84  |
| 买入返售金融资产                 | 49,954,571.11  | -             | -          | -           | 49,954,571.11  |
| 资产总计                     | 116,358,685.86 | 4,505,506.43  | -          | -           | 120,864,192.29 |
| 负债                       |                |               |            |             |                |
| 卖出回购金融资产款                | 31,206,140.07  | -             | -          | -           | 31,206,140.07  |
| 应付管理人报酬                  | -              | -             | -          | 40,278.74   | 40,278.74      |
| 应付托管费                    | -              | -             | -          | 6,713.11    | 6,713.11       |
| 应交税费                     | -              | -             | -          | 797.98      | 797.98         |
| 其他负债                     | -              | -             | -          | 80,160.66   | 80,160.66      |
| 负债总计                     | 31,206,140.07  | -             | -          | 127,950.49  | 31,334,090.56  |
| 利率敏感度缺口                  | 85,152,545.79  | 4,505,506.43  | -          | -127,950.49 | 89,530,101.73  |
| 上年度末<br>2022 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                     | 140,379.15     | -             | -          | -           | 140,379.15     |
| 结算备付金                    | 689,797.72     | -             | -          | -           | 689,797.72     |
| 存出保证金                    | 3,790.10       | -             | -          | -           | 3,790.10       |
| 交易性金融资产                  | 38,554,098.61  | 42,179,021.33 | 680,828.55 | -           | 81,413,948.49  |
| 买入返售金融资产                 | 55,640,407.55  | -             | -          | -           | 55,640,407.55  |
| 应收清算款                    | -              | -             | -          | 488,541.82  | 488,541.82     |
| 资产总计                     | 95,028,473.13  | 42,179,021.33 | 680,828.55 | 488,541.82  | 138,376,864.83 |
| 负债                       |                |               |            |             |                |

|           |               |               |            |            |               |
|-----------|---------------|---------------|------------|------------|---------------|
| 卖出回购金融资产款 | 46,337,260.50 | -             | -          | -          | 46,337,260.50 |
| 应付管理人报酬   | -             | -             | -          | 40,086.53  | 40,086.53     |
| 应付托管费     | -             | -             | -          | 6,681.10   | 6,681.10      |
| 应交税费      | -             | -             | -          | 2,575.46   | 2,575.46      |
| 其他负债      | -             | -             | -          | 81,684.49  | 81,684.49     |
| 负债总计      | 46,337,260.50 | -             | -          | 131,027.58 | 46,468,288.08 |
| 利率敏感度缺口   | 48,691,212.63 | 42,179,021.33 | 680,828.55 | 357,514.24 | 91,908,576.75 |

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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2023年06月30日              | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|    | 市场利率上升25.00bp      | -465,773.64                     | -350,855.83         |
|    | 市场利率下降25.00bp      | 473,897.86                      | 354,328.54          |

#### 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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例介于0%-95%之间，每个交易日日终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

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 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

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 4,505,506.43       | 10,318,588.20       |
| 第二层次          | 64,834,427.41      | 71,095,360.29       |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 69,339,933.84      | 81,413,948.49       |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本报告期，本基金是不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

#### 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，本基金是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，本基金是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            | 69,339,933.84  | 57.37        |
|    | 其中：债券             | 69,339,933.84  | 57.37        |
|    | 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          | 49,954,571.11  | 41.33        |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,561,318.63   | 1.29         |
| 8  | 其他各项资产            | 8,368.71       | 0.01         |
| 9  | 合计                | 120,864,192.29 | 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**

本期末，本基金未持有股票。

**7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

本期末，本基金未持有港股通股票。

**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**

本期末，本基金未持有股票。

**7.4 报告期内股票投资组合的重大变动****7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细**

本期末，本基金未持有股票。

**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**

本期末，本基金未持有股票。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本期末，本基金未持有股票。

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 56,725,409.32 | 63.36        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 6,074,886.58  | 6.79         |
|    | 其中：政策性金融债 | 6,074,886.58  | 6.79         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 2,034,131.51  | 2.27         |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债(可交换债) | 4,505,506.43  | 5.03         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |

|    |    |               |       |
|----|----|---------------|-------|
| 10 | 合计 | 69,339,933.84 | 77.45 |
|----|----|---------------|-------|

### 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  | 019670 | 22国债05 | 90,000 | 9,082,092.33 | 10.14        |
| 2  | 019669 | 22国债04 | 90,000 | 9,081,572.05 | 10.14        |
| 3  | 018065 | 进出2201 | 60,000 | 6,074,886.58 | 6.79         |
| 4  | 019695 | 23国债02 | 50,000 | 5,106,394.52 | 5.70         |
| 5  | 019701 | 23国债08 | 50,000 | 5,075,135.62 | 5.67         |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本期末，本基金未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本期末，本基金未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本期末，本基金未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本期末，本基金未持有股指期货。

### 7.11 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 本基金所持有的进出2201（代码：018065.SH）的发行主体为中国进出口银行，2023年5月9日中国银行间市场交易商协会因其承销业务涉嫌违规对其开展自律调查。

本报告期内，除以上证券外，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。

**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规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 | 8,368.71 |
| 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    | 8,368.71 |

### 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  | 110067 | 华安转债 | 2,339,086.93 | 2.61          |
| 2  | 113052 | 兴业转债 | 2,166,419.50 | 2.42          |

### 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。

### 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

| 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 |
| 1,582    | 45,914.43 | 51,006,227.88 | 70.22% | 21,630,395.69 | 29.78% |

### 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 | 172,560.23 | 0.24%    |

### 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 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金于2014年5月29日基金合同生效，截至本报告期末，本基金的发起人所认购的基金份额持有期限均已过3年的锁定期，本报告不再列示发起资金持有份额情况。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2014年05月29日)基金份额总额 | 198,839,914.33 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 76,738,615.54  |
| 本报告期基金总申购份额                | 60,121,856.86  |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 64,223,848.83  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              |



|             |               |
|-------------|---------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 72,636,623.57 |
|-------------|---------------|

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

在本报告期内，基金管理人同意严命有先生辞去督察长职务；在聘任新的督察长之前由总经理焦毛先生代行江信基金管理有限公司督察长职责。

本报告期内，基金管理人发生董事变更，近12个月内董事变更超过百分之五十。截至本报告期末，本基金基金经理变更为马超然。

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

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

在本报告期内，本基金未改聘会计事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施1                   | 内容                                  |
|-----------------------|-------------------------------------|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 管理人、高级管理人员                          |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2023年04月21日                         |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 北京证监局                               |
| 受到的具体措施类型             | 管理人被采取责令改正行政监管措施，并对相关责任人员采取相应行政监管措施 |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 财务管理、监管报告等存在问题                      |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 管理人已及时整改并报告                         |

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|--------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|        |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 民族证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中银国际证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 广发证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国盛证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 恒泰证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华西证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 上海证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

### 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 |              | 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 |
| 民族证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中银国际证券 | 32,008,746.78  | 15.00%       | 163,118,000.00 | 11.87%         | -    | -            | -    | -            |
| 长城证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 广发证券   | 1,841,315.94   | 0.86%        | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国盛证券   | 30,243,119.93  | 14.17%       | 195,268,000.00 | 14.21%         | -    | -            | -    | -            |
| 恒泰证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华西证券   | -              | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 上海证券   | 117,150,785.21 | 54.90%       | 457,432,000.00 | 33.28%         | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投证券 | 32,147,914.21  | 15.07%       | 558,733,000.00 | 40.65%         | -    | -            | -    | -            |

## 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  | 江信基金2022年第四季度报告提示性公告                          | 证券日报    | 2023-01-18 |
| 2  | 江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（2023年第1次）      | 网站      | 2023-02-23 |
| 3  | 江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书更新（2023年第1号）         | 网站      | 2023-02-23 |
| 4  | 江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金2022年年度报告                 | 网站      | 2023-03-30 |
| 5  | 江信基金2022年年度报告提示性公告                            | 证券日报    | 2023-03-30 |
| 6  | 江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金2023年第一季度报告               | 网站      | 2023-04-20 |
| 7  | 江信基金管理有限公司旗下全部基金2023年第一季度报告提示性公告              | 证券日报    | 2023-04-20 |
| 8  | 江信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                      | 网站、证券日报 | 2023-05-05 |
| 9  | 江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务公告（2023年6月） | 网站、证券日报 | 2023-06-01 |
| 10 | 江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告                  | 网站、证券日报 | 2023-06-30 |

## §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              | 20230101-20230630      | 16,729,964.87 | 34,625,029.30 | 16,729,964.87 | 34,625,029.30 | 47.67% |
|        | 2              | 20230101-20230606      | 16,756,598.24 | 0.00          | 16,756,598.24 | 0.00          | 0.00%  |
| 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、《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 3、《江信聚福定期开放债券型发起式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  
二〇二三年八月三十日