

# 江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09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

报告送出日期:2024年10月25日

## 目录

|  |    |
|--|----|
| §1 重要提示 .....                                  | 3  |
| §2 基金产品概况 .....                                | 3  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 .....                         | 6  |
| 3.1 主要财务指标 .....                               | 6  |
| 3.2 基金净值表现 .....                               | 6  |
| §4 管理人报告 .....                                 | 8  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 .....                      | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....               | 9  |
| 4.3 公平交易专项说明 .....                             | 9  |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 .....                     | 9  |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现 .....                          | 10 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 .....                | 11 |
| §5 投资组合报告 .....                                | 11 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 .....                         | 11 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                     | 11 |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 .....     | 12 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                   | 13 |
| 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....     | 13 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 ..... | 13 |
| 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....    | 13 |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....     | 13 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....                 | 13 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                | 13 |
| 5.11 投资组合报告附注 .....                            | 13 |
| §6 开放式基金份额变动 .....                             | 14 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 .....                    | 15 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息 .....                        | 15 |
| 8.1 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 .....        | 15 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                       | 15 |
| §9 备查文件目录 .....                                | 15 |
| 9.1 备查文件目录 .....                               | 15 |
| 9.2 存放地点 .....                                 | 15 |
| 9.3 查阅方式 .....                                 | 15 |

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至2024年09月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 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   |
| 报告期末基金份额总额 | 708,962.65份   |
| 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       | <p>1.资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2.股票投资策略</p> <p>在股票投资上本基金主要根据上市公司获利能力、资</p> |

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

|                 |   |                                |
|-----------------|---|--------------------------------|
|                 | <p>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。</p> <p>6.权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证的投资。</p> <p>1) 综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素，根据BS模型和溢价率对权证的合理价值做出判断，对价值被低估的权证进行投资；</p> <p>2) 基于对权证标的股票未来走势的预期，充分利用权证的杆杆比率高的特点，对权证进行单边投资；</p> <p>3) 基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断，将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资，或利用权证进行风险对冲。</p> <p>7.资产支持证券等品种投资策略</p> <p>资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。</p> |                                |
| 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。   |                                |
| 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  |                                |
| 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 | 332,042.16份   | 376,920.49份                    |
| 下属分级基金的风险收益特征   | 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   | 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 |

|  |  |   |
|--|--|---|
|  | 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。 | 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。 |
|--|--|---|

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。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期(2024年07月01日 - 2024年09月30日) |            |
|----------------|--------------------------------|------------|
|                | 江信瑞福A                          | 江信瑞福C      |
| 1.本期已实现收益      | 2,959.34                       | 3,538.00   |
| 2.本期利润         | 79,842.19                      | 84,648.65  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2093                         | 0.2099     |
| 4.期末基金资产净值     | 416,787.37                     | 444,196.99 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.2552                         | 1.1785     |

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

江信瑞福A净值表现

| 阶段    | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 23.95%  | 1.71%     | 7.64%      | 0.65%         | 16.31%  | 1.06% |
| 过去六个月 | 21.29%  | 1.24%     | 7.79%      | 0.52%         | 13.50%  | 0.72% |
| 过去一年  | 30.48%  | 1.40%     | 7.39%      | 0.46%         | 23.09%  | 0.94% |
| 过去三年  | -20.27% | 1.40%     | -2.90%     | 0.51%         | -17.37% | 0.89% |
| 过去五年  | 33.02%  | 1.34%     | 14.42%     | 0.59%         | 18.60%  | 0.75% |
| 自基金合同 | 25.52%  | 1.29%     | 26.30%     | 0.59%         | -0.78%  | 0.70% |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

## 江信瑞福C净值表现

| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 23.79%  | 1.71%     | 7.64%      | 0.65%         | 16.15%  | 1.06% |
| 过去六个月      | 20.96%  | 1.24%     | 7.79%      | 0.52%         | 13.17%  | 0.72% |
| 过去一年       | 29.72%  | 1.40%     | 7.39%      | 0.46%         | 22.33%  | 0.94% |
| 过去三年       | -21.52% | 1.40%     | -2.90%     | 0.51%         | -18.62% | 0.89% |
| 过去五年       | 30.57%  | 1.34%     | 14.42%     | 0.59%         | 16.15%  | 0.75% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.85%  | 1.29%     | 26.30%     | 0.59%         | -8.45%  | 0.70% |

## 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

江信瑞福A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年02月17日-2024年09月30日)

江信瑞福C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年02月17日-2024年09月30日)

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                | 任本基金的基金经理期限 |      | 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，投资权益总部总监 | 2020-10-26  | -    | 10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 |

|  |  |  |  |  |    |
|--|--|--|--|--|----|
|  |  |  |  |  | 理。 |
|--|--|--|--|--|----|

(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》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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年第三季度，全球经济增长动能依然不强，主要经济体的经济表现有所分化，多个主要经济体均进入了货币政策降息周期。美联储在9月18日宣布将联邦基金利率目标区间下调50个基点，降至4.75%至5.00%之间，这是自2020年3月以来的首次降息。此举标志着美国货币政策开启新一轮宽松周期，旨在提振就业市场和应对经济放缓的风险。

美联储的降息行动也带动了其他主要经济体的货币政策调整，欧洲央行、加拿大央行、韩国等纷纷跟进降息。

2024年第三季度，中国经济继续保持平稳运行，但面临外部环境的不确定性、内部有效需求不足、地方债务、房地产、人口和就业等主要问题，经济健康发展受到了一定的挑战。

面对这些问题，9月底，政府出台了一系列刺激经济和资本市场的政策组合拳，旨在提振经济增长和市场信心。这些政策涵盖货币政策、房地产市场支持、资本市场改革和财政政策等多个方面，具体如：降准降息：央行宣布将存款准备金率下调0.5个百分点，释放长期流动性约1万亿元。此外，7天期逆回购操作利率下调0.2个百分点，带动贷款市场报价利率（LPR）和存款利率同步下行，降低社会融资成本。创设新货币政策工具：央行推出证券、基金、保险公司互换便利和股票回购、增持专项再贷款，分别提供5000亿元和3000亿元的流动性支持，提升市场流动性和股票增持能力。降低房贷利率：引导商业银行将存量房贷利率降至新发放贷款利率附近，平均降幅约0.5个百分点。统一首付比例：将全国层面的二套房贷款最低首付比例由25%降至15%，与首套房首付比例持平。保障性住房再贷款：将3000亿元保障性住房再贷款的央行资金支持比例由60%提高到100%，增强对银行和收购主体的市场化激励。推动中长期资金入市：证监会发布促进中长期资金入市的指导意见，鼓励社保、保险等长期资金入市，优化资本市场投资者结构。促进并购重组：证监会发布《关于深化上市公司并购重组市场改革的意见》，支持上市公司向新质生产力方向转型升级，简化审核程序，提高交易效率。加大财政支出：政府强调要加大财政货币政策逆周期调节力度，保证必要的财政支出，发行使用好超长期特别国债和地方政府专项债，以发挥政府投资的带动作用。支持地方债务置换：加力支持地方开展债务置换，化解债务风险，增强地方政府的财政能力。

其他支持措施：优化营商环境：进一步规范涉企执法行为，优化市场准入制度，推动民营经济发展。促进消费：把促消费和惠民生结合起来，促进中低收入群体增收，提升消费结构。

这些政策的出台，反映了政府对当前经济形势的积极应对态度，旨在通过多方面的政策支持，稳定市场预期，提振内需，促进经济的平稳增长。同时，通过支持资本市场和房地产市场的健康发展，增强经济的内在稳定性和活力。

三季度，本基金采用基本面动量趋势多空择时策略模型辅助进行选股，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。筛选出主线后持仓相对集中。

参考多空择时系统的打分结果，在9月中旬陆续增加仓位权重，从极低仓位逐渐加仓至较高仓位。

#### 4.5 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1.2552元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为23.95%，同期业绩比较基准收益率为7.64%；截至报告期末江信瑞福C基金份额净值为1.1785元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为23.79%，同期业绩比较基准收益率为7.64%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)      | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 692,121.00 | 72.55         |
|    | 其中：股票             | 692,121.00 | 72.55         |
| 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      | 194,528.17 | 20.39         |
| 8  | 其他资产              | 67,301.88  | 7.06          |
| 9  | 合计                | 953,951.05 | 100.00        |

由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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      | 369,908.00 | 42.96         |

|   |                  |            |       |
|---|------------------|------------|-------|
| 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           | 36,936.00  | 4.29  |
| 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  | 186,736.00 | 21.69 |
| J | 金融业              | 98,541.00  | 11.45 |
| 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               | 692,121.00 | 80.39 |

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 301236 | 软通动力 | 1,200 | 61,824.00 | 7.18         |
| 2  | 300476 | 胜宏科技 | 1,500 | 59,550.00 | 6.92         |
| 3  | 300857 | 协创数据 | 700   | 48,265.00 | 5.61         |
| 4  | 603383 | 顶点软件 | 1,200 | 45,240.00 | 5.25         |
| 5  | 000550 | 江铃汽车 | 1,500 | 42,030.00 | 4.88         |
| 6  | 000997 | 新大陆  | 2,400 | 41,064.00 | 4.77         |
| 7  | 300059 | 东方财富 | 2,000 | 40,600.00 | 4.72         |
| 8  | 601138 | 工业富联 | 1,600 | 40,304.00 | 4.68         |
| 9  | 601995 | 中金公司 | 1,000 | 38,610.00 | 4.48         |
| 10 | 300598 | 诚迈科技 | 800   | 38,608.00 | 4.48         |

#### 5.4 报告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。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

本基金所持有的中金公司（601995.SH）的发行主体中国国际金融股份有限公司，2024年1月5日中国证券监督管理委员会因发行人定期报告披露违规对其出具警示函；2024年1月12日浙江证监局因发行人公司运作、治理违规，对其采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案；2024年4月28日中国证监会北京监管局因发行人公司运作、治理违规对其采取出具警示函的行政监管措施（京证监措施[2024]97号）；2024年5月9日中国证监会北京监管局因发行人公司运作、治理违规对其采取责令改正（京证监措施[2024]117号）；2024年9月29日中国证监会北京监管局因发行人公司运作、治理违规对其采取出具警示函的行政监管措施（京证监措施[2024]249号）。

5.11.2 本基金本报告期末不存在投资于超过基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 44.77     |
| 2  | 应收证券清算款 | 63,367.38 |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 3,889.73  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 67,301.88 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                               | 江信瑞福A      | 江信瑞福C      |
|-------------------------------|------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 415,752.93 | 455,142.48 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 4,247.58   | 7,999.36   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 87,958.35  | 86,221.35  |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -          | -          |

|             |            |            |
|-------------|------------|------------|
| 报告期期末基金份额总额 | 332,042.16 | 376,920.49 |
|-------------|------------|------------|

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 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。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §9 备查文件目录

#### 9.1 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。

#### 9.2 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>。

#### 9.3 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

2024年10月25日