

英大纯债债券型证券投资基金2014年年度报告

2014年12月31日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015年03月27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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月23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。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告.....	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告.....	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
8.6 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.....	46
8.7 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.....	46
8.8 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.....	46
8.9 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.....	46
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
8.12 投资组合报告附注.....	47
§9 基金份额持有人信息.....	48

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
9.3 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	49
§10 开放式基金份额变动	50
§11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
11.2 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	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4 基金投资策略的改变	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	52
§12 影响投资者决策的其他重要信息	55
§13 备查文件目录	55
13.1 备查文件目录	55
13.2 存放地点	56
13.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	英大纯债债券型证券投资基金	
基金简称	英大纯债债券	
基金主代码	650001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年04月24日	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	65,797,343.16份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	英大纯债债券A	英大纯债债券C
下属分级基金的交易代码	650001	650002
报告期末下属分级基金的份 额总额	15,496,754.16份	50,300,589.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于固定收益类资产，在有效控制投资组合风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金依据宏观经济运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场收益特征，分析判断市场利率水平变动趋势，并预测下一阶段的利率水平，结合各类别资产的收益性、风险性和流动性特征，进行大类资产配置。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，该类基金长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，但高于货币市场基金，属于中低风险和收益水平的投资品种。

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	英大基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

			司
信息披露负责人	姓名	张宁	田青
	联系电话	010-59112066	010-67595096
	电子邮箱	zhangning@ydamc.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-890-5288	010-67595096
传真		010-85878087	010-66275853
注册地址		北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100020	100033
法定代表人		张传良	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ydamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层
注册登记机构	英大基金管理有限公司	北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	英大纯债债券A	
	2014年	2013年04月24日-2013年12月31日
本期已实现收益	-6,810,002.53	-1,476,837.94
本期利润	14,659,162.65	-20,125,895.69
加权平均基金份额本期利润	0.0997	-0.0357
本期基金加权平均净值利润率	10.25%	-3.60%
本期基金份额净值增长率	14.01%	-4.52%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	424,495.76	-13,793,632.00
期末可供分配基金份额利润	0.0274	-0.0452
期末基金资产净值	16,870,150.71	291,471,865.72
期末基金份额净值	1.0886	0.9548
3.1.3 累计期末指标	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	8.86%	-4.52%

3.1.4 期间数据和指标	英大纯债债券C	
	2014年	2013年04月24日-2013年12月31日
本期已实现收益	2,639,352.43	1,422,262.89
本期利润	8,351,806.88	-5,901,357.86
加权平均基金份额本期利润	0.1235	-0.0222
本期基金加权平均净值利润率	12.29%	-2.23%
本期基金份额净值增长率	13.49%	-4.81%
3.1.5 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	975,765.22	-4,067,848.16
期末可供分配基金份额利润	0.0194	-0.0481
期末基金资产净值	54,340,205.81	80,499,151.72
期末基金份额净值	1.0803	0.9519

3.1.6 累计期末指标	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	8.03%	-4.81%

注：①所述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。

②期末可供分配利润为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。

③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 (英大纯债债券A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.13%	0.27%	1.66%	0.17%	1.47%	0.10%
过去六个月	8.07%	0.21%	2.37%	0.13%	5.70%	0.08%
过去一年	14.01%	0.20%	6.54%	0.11%	7.47%	0.09%
自基金合同生效日起至今（2013年04月24日-2014年12月31日）	8.86%	0.19%	1.52%	0.11%	7.34%	0.08%

注：①本基金合同于2013年4月24日生效；

②本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

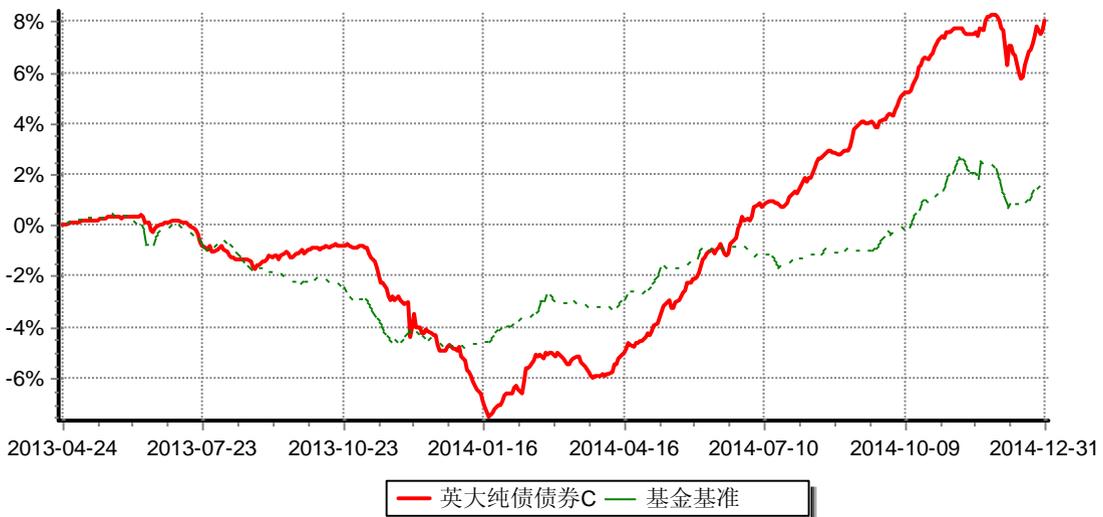
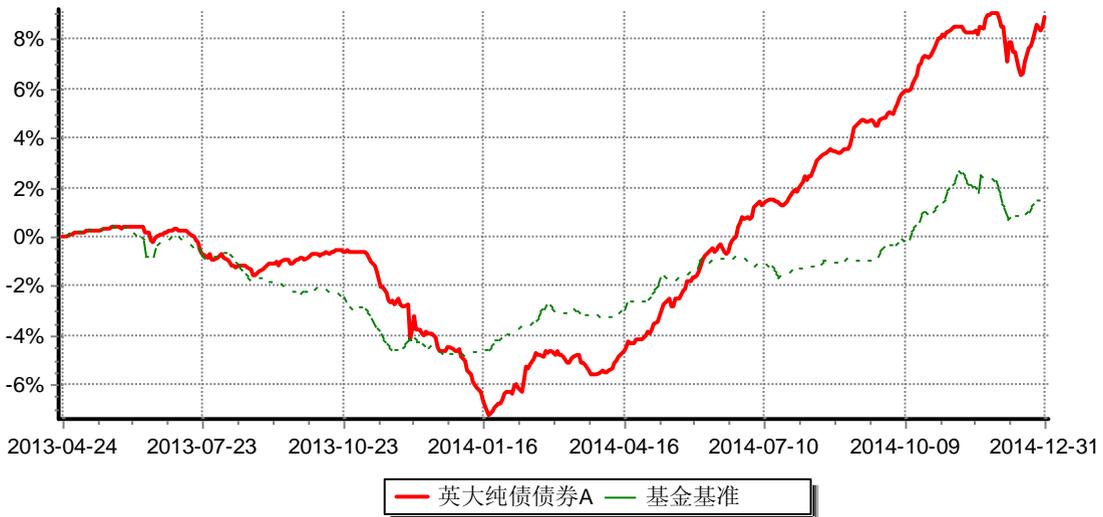
阶段 (英大纯债债券C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.01%	0.27%	1.66%	0.17%	1.35%	0.10%
过去六个月	7.81%	0.21%	2.37%	0.13%	5.44%	0.08%
过去一年	13.49%	0.20%	6.54%	0.11%	6.95%	0.09%
自基金合同生效日起至今（2013年04月24日-2014年12月31日）	8.03%	0.19%	1.52%	0.11%	6.51%	0.08%

日-2014年12月31日)						
----------------	--	--	--	--	--	--

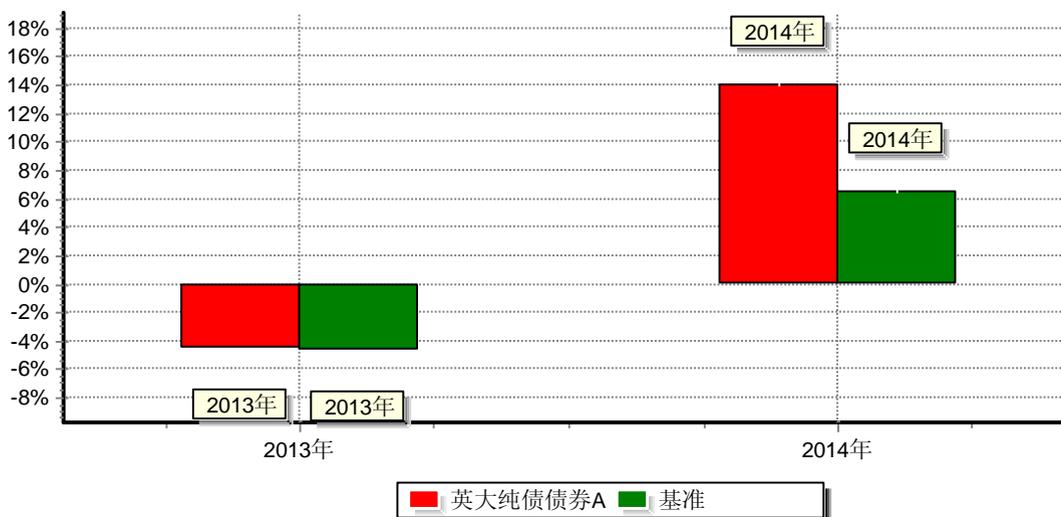
注：①本基金合同于2013年4月24日生效；

②本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

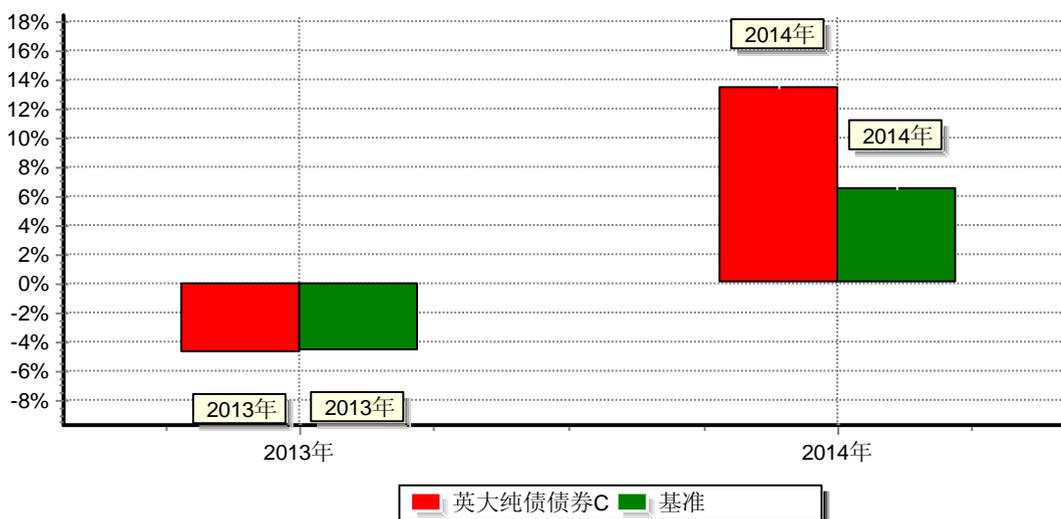
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为2013年4月24日。



注：本基金基金合同生效日为2013年4月24日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未进行利润分配。

§ 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

2012年8月17日，经中国证监会批准，英大基金管理有限公司在北京正式成立。公司由英大国际信托有限责任公司（简称英大信托）、中国交通建设股份有限公司（简称中

交股份)和航天科工财务有限责任公司(简称航天科工财务)三家股东发起成立。英大基金注册资金已增资至2亿元人民币,其中英大信托出资比例为49%,中交股份出资比例为36%,航天科工财务出资比例为15%。

截至报告期末,本公司管理3只开放式证券投资基金-英大纯债债券型证券投资基金、英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币基金,同时,管理多个特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘熹	总经理助理,本基金基金经理	2013年04月24日	2013年09月09日	13	历任嘉实基金管理有限公司投资决策委员会委员,固定收益部副总监、总监,社保债券基金经理、公募债券基金经理;招商证券研发中心高级研究员;巨田证券投资部副经理;平安证券国债部、平安集团投资管理中心投资经理。2012年加入英大基金管理有限公司,于2013年9月9日离职。
李岚	本基金基金经理	2013年09月09日	2014年11月03日	6	曾任深圳发展银行深圳龙岗支行信贷员,平安资产管理有限责任公司研究员,中国人保资产管理股份有限公司投资经理,安邦资产管理有限责任公司部门副总等职。2012年9月加入英大基金管理有限公司。
张琳娜	本基金基金经理	2014年10月24日	—	8	对外经济贸易大学金融学硕士,8年基金从业经历。先后任益民基金管理有限

					公司集中交易部交易员、副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限公司，曾任公司交易管理部副总经理（主持工作），现任固定收益部副总经理。
--	--	--	--	--	---

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，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》、《英大纯债债券型证券投资基金招募说明书》的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，因市场波动导致本基金净值发生波动，致使本基金持有单只债券的持仓比例被动超过10%。上述情况发生后，公司在征得监管机构和托管银行的理解和同意后，积极应对，将该指标调整到了合规水平。除上述情况外，本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等国家法律法规和监管部门的规定，公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》，适用于公司所管理的全部公募基金、特定客户资产管理组合、社保基金、企业年金等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括公司的投资决策实行投资决策委员会领导下的基金经理/投资经理负责制，明确各自的投资权限，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，交易执行部门与投资决策部门严格分离，业绩与风险评估以数量分析为基础，对投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程，明确投资各环节的业务职责，防范投资风险。公司的所有投资组合共享公司统一的投资研究平台，投资研究团队使用同一研究报告系统，确保公募基金、特定客户资产管理组合等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括公司建立交易分配公平的内部控制流程，将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并确保

公平交易可操作、可稽核、可持续。公司在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，以技术措施保障公平交易的实现。

监察稽核部定期对公司的不同投资组合（尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合）在连续四个季度期间内、不同时间窗下（1日内、3日内、5日内等）的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年债券市场经过一季度的小幅调整后全年大幅上扬。GDP增速不佳，经济下行，CPI保持低位，央行持续通过定向宽松方式向市场注入流动性，无论从宏观方面还是资金面方面都为债券市场的牛市保驾护航。本基金在2014年跟随债券市场牛市净值从下跌走向上涨，并不断的创出新高。从全年来看，本基金很好的享受了牛市带来的收益。

未来，本基金将在保障流动性的前提下，继续调整和优化债券持仓结构，降低组合久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，英大纯债A类基金份额净值为1.0886元，报告期基金份额净值增长率为14.01%；英大纯债C类基金份额净值为1.0803元，报告期基金份额净值增长率为13.49%；同期业绩比较基准增长率6.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年是中国经济震荡的一年，GDP增速减慢，房地产低迷，经济下行压力较大，宽松政策频繁出手对冲经济下滑，但效果还未显现。展望2015年，预计经济形势仍不容乐观，但并不悲观，经济依然受投资驱动，基建等稳增长措施将逐步显现效果，一带一

路、国企改革都将给经济注入新的活力。同时利率市场化、汇率以及国际油价的大幅波动，都将给经济带来新的挑战。受房地产投资增速放缓、中央43号文对城投企业再融资的影响，债券市场波动将加大。14年央行创设并频繁使用的几种定向工具将在15年继续使用，叠加IPO的提速，总体判断2015年流动性将保持一种紧平衡。结合我们目前的持仓，展望2015年，本基金的操作思路重点放在深入研究精选个券防范信用风险上，在保障流动性的前提下，调整和优化持仓债券结构，进一步降低组合久期，力争为投资人提供稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人管理的基金整体运作合法合规，依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度，在督察长的指导和监察稽核部的努力下，开展了一系列监察稽核工作。采取的主要措施如下：

1)据国家法律法规的变化和公司业务发展的需要，按照规定程序对公司基本管理制度进行全面梳理，对内部控制大纲、风险控制制度等基本制度进行修订，进一步完善公司的内部控制体系；

2)保持与监管机构的联系，以"守住三条底线"、防控内幕交易为基础，多次组织各业务条线学习最新的监管要求和法律法规，加强全体员工的合规和风险意识；

3)监督检查基金资产运作，就资产运作的合法合规性和有效性进行独立、客观的分析，并向督察长汇报；

4)根据监管机构的要求以及基金资产运作情况开展公司的监察稽核工作，出具监察稽核报告，并按照规定程序上报督察长、公司董事和监管机构；

5)对基金投资与专户投资的公平交易、异常交易情况进行分析，并出具交易分析报告；

6)按照公司的内部管理制度开展反洗钱、反不正当竞争和商业贿赂、反内幕交易等工作，并按照公司《信息披露管理制度》的有关规定开展信息披露工作；

7)对基金合同、宣传推介材料、涉及基金份额持有人和公司利益的对外言论等进行审查，并出具合规意见，有效防范风险，规避违法违规行为的发生；

8)配合监管部门和外聘会计师事务所开展本基金的审计事务，并向公司员工提供法律咨询服务；

9)组织对公司在报告期内离职的基金经理进行离任审计。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，基金日常估值由基金管理人进行。

基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以电子形式报给基金托管人，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，基金托管人复核无误后以电子签名形式返回给基金管理人，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。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会。估值委员会主任由主管运营公司领导担任，成员包括投资总监、基金经理，研究、交易、监察稽核部门负责人，基金运营部相关负责人。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

过去三年本基金未进行利润分配，本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	瑞华审字[2015]第01390126号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	英大纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的英大纯债债券型证券投资基金(以下简称"英大纯债基金")的财务报表，包括2014年12月31日的资产负债表、2014年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是英大纯债基金的基金管理人英大基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"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财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的</p>

	<p>财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述英大纯债基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所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，公允反映了英大纯债基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	张琴 张庆瑞
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层
审计报告日期	2015-03-27

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：英大纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	8,080,850.57	20,222,319.75
结算备付金		614,562.43	7,577,334.05
存出保证金		16,962.47	17,483.46
交易性金融资产	7.4.7.2	100,197,878.43	557,952,994.22
其中：股票投资		—	—

基金投资		—	—
债券投资		100,197,878.43	557,952,994.22
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	800,000.00
应收证券清算款		1,999,994.90	18,936,745.05
应收利息	7.4.7.5	2,960,883.58	17,494,981.27
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		113,871,132.38	623,001,857.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		42,063,945.70	209,803,615.10
应付证券清算款		7,546.87	38,531,649.60
应付赎回款		316,520.48	1,877,740.22
应付管理人报酬		49,634.53	256,416.17
应付托管费		14,181.26	73,261.77
应付销售服务费		20,735.18	30,741.80
应付交易费用	7.4.7.7	465.00	2,139.01
应交税费		—	—
应付利息		27,592.61	254,500.89
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	160,154.23	200,775.80

负债合计		42,660,775.86	251,030,840.36
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	65,797,343.16	389,832,497.60
未分配利润	7.4.7.10	5,413,013.36	-17,861,480.16
所有者权益合计		71,210,356.52	371,971,017.44
负债和所有者权益总计		113,871,132.38	623,001,857.80

注：报告截止日2014年12月31日，英大纯债债券A基金份额净值1.0886元，基金份额总额15,496,754.16份；英大纯债债券C基金份额净值1.0803元，基金份额总额50,300,589.00份。英大纯债债券基金份额总额合计为65,797,343.16份。

7.2 利润表

会计主体：英大纯债债券型证券投资基金

本报告期：2014年01月01日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年01月01日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年04月24日至 2013年12月31日
一、收入		29,591,068.31	-15,488,930.23
1.利息收入		19,104,566.86	34,313,607.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	107,949.86	4,940,269.16
债券利息收入		18,964,249.06	27,009,266.51
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		32,367.94	2,364,071.82
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,751,691.71	-24,000,151.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	-16,751,691.71	-24,000,151.36
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	—	—

贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—
股利收益	7.4.7.16	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	27,181,619.63	-25,972,678.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	56,573.53	170,292.14
减：二、费用		6,580,098.78	10,538,323.32
1. 管理人报酬		1,486,555.14	4,001,190.44
2. 托管费		424,730.01	1,143,197.38
3. 销售服务费		271,844.58	737,181.64
4. 交易费用	7.4.7.19	12,351.97	18,213.65
5. 利息支出		4,217,286.24	4,408,318.61
其中：卖出回购金融资产支出		4,217,286.24	4,408,318.61
6. 其他费用	7.4.7.20	167,330.84	230,221.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,010,969.53	-26,027,253.55
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,010,969.53	-26,027,253.55

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：英大纯债债券型证券投资基金

本报告期：2014年01月01日至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2014年01月01日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	389,832,497.60	-17,861,480.16	371,971,017.44

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		23,010,969.53	23,010,969.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-324,035,154.44	263,523.99	-323,771,630.45
其中：1.基金申购款	138,118,621.82	2,678,663.71	140,797,285.53
2.基金赎回款	-462,153,776.26	-2,415,139.72	-464,568,915.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	65,797,343.16	5,413,013.36	71,210,356.52
项 目	上年度可比期间2013年04月24日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,495,284,612.40	—	1,495,284,612.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-26,027,253.55	-26,027,253.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,105,452,114.80	8,165,773.39	-1,097,286,341.41
其中：1.基金申购款	81,270,864.98	-653,241.19	80,617,623.79
2.基金赎回款	-1,186,722,979.78	8,819,014.58	-1,177,903,965.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	389,832,497.60	-17,861,480.16	371,971,017.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

杨峰

赵照

吕向鹏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

英大纯债债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可【2013】第126号《关于核准英大纯债债券型证券投资基金募集的批复》核准,由英大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《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,494,717,488.32元,业经北京兴华会计师事务所有限责任公司(2013)京会兴验字第02010096号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》于2013年4月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,495,284,612.40份基金份额(其中英大纯债债券A基金份额为811,221,644.46份,英大纯债债券C基金份额为684,062,967.94份),认购资金利息折合567,124.08份基金份额(其中英大纯债债券A基金份额为318,970.18份,英大纯债债券C基金份额为248,153.90份)。本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》和《英大纯债债券型证券投资基金招募说明书》,并报中国证监会备案。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的,而不计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本基金类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设基金代码。由于基金费用的不同,本基金A类、C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购/申购的基金类别。本基金A类基金份额和C类基金份额之间不得互相转换。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业(公司)债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、中票、债券回购、短期融资券、银行存款、中小企业私募债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合的比例范围为:本基金投资于固定收益类资产(含可转换债券和中小企业私募债券)的比例不低于基金资产的80%;持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和41项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四中所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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。此外，本财务报表在所有重大方面符合中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》中有关财务报表及其附注的披露要求。

7.4.4 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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

人民币

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。卖出股票、基金、债券等金融资产的成本按移动加权平均法逐日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金及适用利率逐日计提。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时采用合同利率）在回购期内逐日计提。

（2）投资收益

股票投资收益于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代

扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理人报酬按照前一日基金资产净值的0.7%的年费率逐日计提。

(2) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率逐日计提。

(3) 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按照前一日C类基金资产净值的0.4%的年费率逐日计提。

(4) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时采用合同利率）在回购期内逐日计提。

(5) 其他费用根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法，在受益期内分摊计入本期和以后各期。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

7.4.4.13 分部报告

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金将根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》确定估值方法进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

2014年初，财政部分别以财会[2014]6号、16号发布了《企业会计准则第39号--公允价值计量》、《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》，要求自2014年7月1日起在所有执行企业会计准则的企业范围内施行，鼓励在境外上市的企业提前执行。另外，财政部以财会[2014]23号发布了《企业会计准则第37号--金融工具列报（2014年修订）》（以下简称“金融工具列报准则”），要求在2014年年度及以后期间的财务报告中按照该准则的要求对金融工具进行列报。

本基金于2014年7月1日开始执行前述2项新颁布或修订的企业会计准则，在编制2014年年度财务报告时开始执行金融工具列报准则。本基金列报的前期财务报表不涉及因上述会计政策变更需追溯调整事项。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额，上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
活期存款	8,080,850.57	20,222,319.75
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	8,080,850.57	20,222,319.75

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2014年12月31日		
	成本	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	86,884,647.52	88,193,878.43
	银行间市场	12,104,289.78	12,004,000.00
	合计	98,988,937.30	100,197,878.43
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	98,988,937.30	100,197,878.43	1,208,941.13
项目	上年度末2013年12月31日		
	成本	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	503,786,046.42	479,502,994.22	-24,283,052.20
	银行间市场	80,139,626.30	78,450,000.00	-1,689,626.30
	合计	583,925,672.72	557,952,994.22	-25,972,678.50
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		583,925,672.72	557,952,994.22	-25,972,678.50

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

项目	上年度末2013年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	800,000.00	—

7.4.7.4.1 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2014年12月31日	上年度末2013年12月31日
应收活期存款利息	—	—
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	635.90	2,127.27
应收结算备付金利息	566.97	4,662.50
应收债券利息	2,959,520.24	17,488,182.81
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	152.00	—

应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	8.47	8.69
合计	2,960,883.58	17,494,981.27

7.4.7.6 其他资产

本期末及上年度末，本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2014年12月31日	上年度末2013年12月31日
交易所市场应付交易费用	—	—
银行间市场应付交易费用	465.00	2,139.01
合计	465.00	2,139.01

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2014年12月31日	上年度末2013年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	154.23	775.80
会计师费	60,000.00	100,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
合计	160,154.23	200,775.80

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (英大纯债债券A)	本期2014年01月01日至2014年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	305,265,497.72	305,265,497.72
本期申购	3,140,236.33	3,140,236.33
本期赎回(以“-”号填列)	-292,908,979.89	-292,908,979.89
本期末	15,496,754.16	15,496,754.16
项目	基金份额(份)	账面金额

(英大纯债债券C)		
上年度末	84,566,999.88	84,566,999.88
本期申购	134,978,385.49	134,978,385.49
本期赎回(以“-”号填列)	-169,244,796.37	-169,244,796.37
本期末	50,300,589.00	50,300,589.00

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (英大纯债债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,263,466.59	-8,530,165.41	-13,793,632.00
本期利润	-6,810,002.53	21,469,165.18	14,659,162.65
本期基金份额交易产生的变动数	12,497,964.88	-11,990,098.98	507,865.90
其中：基金申购款	-107,769.13	231,971.46	124,202.33
基金赎回款	12,605,734.01	-12,222,070.44	383,663.57
本期已分配利润	—	—	—
本期末	424,495.76	948,900.79	1,373,396.55

注：注：本表涉及报告期内未分配利润的变动项目中，如为利润减少或亏损，以“-”号填列。

单位：人民币元

项目 (英大纯债债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,707,124.61	-2,360,723.55	-4,067,848.16
本期利润	2,639,352.43	5,712,454.45	8,351,806.88
本期基金份额交易产生的变动数	43,537.40	-287,879.31	-244,341.91
其中：基金申购款	-5,972,771.11	8,527,232.49	2,554,461.38
基金赎回款	6,016,308.51	-8,815,111.80	-2,798,803.29
本期已分配利润	—	—	—
本期末	975,765.22	3,063,851.59	4,039,616.81

注：注：本表涉及报告期内未分配利润的变动项目中，如为利润减少或亏损，以“-”号填列。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年04月24日至2013年 12月31日
活期存款利息收入	41,383.83	162,388.16
定期存款利息收入	—	4,726,504.97
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	62,892.35	47,005.68
其他	3,673.68	4,370.35
合计	107,949.86	4,940,269.16

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益。

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年04月24日至2013年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-16,751,691.71	-24,000,151.36
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	-16,751,691.71	-24,000,151.36

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年04月24日至2013年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成交总额	832,900,946.63	646,988,717.89
减：卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成本总额	823,802,081.62	649,979,680.67
减：应收利息总额	25,850,556.72	21,009,188.58
买卖债券差价收入	-16,751,691.71	-24,000,151.36

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

7.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2014年01月01日至2014年 12月31日	2013年04月24日至2013年 12月31日
1.交易性金融资产	27,181,619.63	-25,972,678.50
——股票投资	—	—
——债券投资	27,181,619.63	-25,972,678.50
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2.衍生工具	—	—
——权证投资	—	—
3.其他	—	—
合计	27,181,619.63	-25,972,678.50

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年04月24日至2013年 12月31日
基金赎回费收入	56,573.53	139,964.96
其他	—	30,327.18
合计	56,573.53	170,292.14

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年04月24日至2013年 12月31日
交易所市场交易费用	11,271.97	14,663.65
银行间市场交易费用	1,080.00	3,550.00
合计	12,351.97	18,213.65

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年04月24日至2013年 12月31日
审计费用	20,000.00	100,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
乙类帐户维护费	27,000.00	6,000.00
银行费用	19,930.84	23,321.60
其他	400.00	900.00
合计	167,330.84	230,221.60

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
英大基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：①下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

②本报告期本基金关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.10.1.4 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.5 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年04月24日至2013年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,486,555.14	4,001,190.44
其中：支付销售机构的客户维护费	429,026.37	2,743,840.00

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.7% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年01月01日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年04月24日至2013年12 月31日
当期发生的基金应支	424,730.01	1,143,197.38

付的托管费		
-------	--	--

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2014年01月01日至2014年12月31日		
	英大纯债债券A	英大纯债债券C	合计
英大基金管理有限公司	—	108,911.01	108,911.01
中国建设银行股份有限公司	—	150,198.18	150,198.18
合计		259,109.19	259,109.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2013年04月24日至2013年12月31日		
	英大纯债债券A	英大纯债债券C	合计
英大基金管理有限公司		21,929.21	21,929.21
中国建设银行股份有限公司	—	693,175.80	693,175.80
合计		715,105.01	715,105.01

注：①C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。在通常情况下，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：日C类基金份额销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×0.40%/当年天数，销售服务费每日计提，按月支付。C类基金份额的销售服务费主要用于本基金的持续销售以及基金份额持有人的服务。

②A类基金份额不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末其他关联方未持有本基金。

7.4.10.5 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	
	2014年01月01日至2014年12月31日		2013年04月24日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	8,080,850.57	41,383.83	20,222,319.75	162,388.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金未在无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本报告期及上年度可比期间,本基金无利润分配事项。

7.4.12 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末（2014年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末（2014年12月31日）未持有需披露的暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2014年12月31日止，本基金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为0.00元。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31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42,063,945.70元，分别于2015年1月5日——2月2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和/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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

7.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，建立债券投资库，同时追踪持仓债券发行人的相关风险事件，以控制可能出现的信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 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 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
A-1	10,141,186.30	—
A-1以下	—	—
未评级	—	20,111,166.00
合计	10,141,186.30	20,111,166.00

注：1.2013年末未评级债券为超短期融资券，无债项评级。

7.4.13.2.2 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 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
AAA	5,206,447.95	36,811,823.70
AAA以下	75,502,304.92	474,277,755.70
未评级	12,307,459.50	44,240,431.60
合计	93,016,212.37	555,330,011.00

注：1.未评级债券包括国家债券、央行票据、政策性金融债和私募债。

7.4.13.3 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方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注7.4.12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，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格

因素的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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受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、部分应收申购款、债券投资及买入返售金融资产等。生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2014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	8,080,850.57	—	—	—	8,080,850.57
结算备付金	614,562.43	—	—	—	614,562.43
存出保证金	16,962.47	—	—	—	16,962.47
交易性金融资产	22,905,443.83	39,023,232.60	38,269,202.00	—	100,197,878.43
应收证券清算款	—	—	—	1,999,994.90	1,999,994.90
应收利息	—	—	—	2,960,883.58	2,960,883.58
资产总计	31,617,819.30	39,023,232.60	38,269,202.00	4,960,878.48	113,871,132.38
负债					
卖出回购金融资产款	42,063,945.70	—	—	—	42,063,945.70
应付证券清算款	—	—	—	7,546.87	7,546.87
应付赎回款	—	—	—	316,520.48	316,520.48
应付管理人报酬	—	—	—	49,634.53	49,634.53
应付托管费	—	—	—	14,181.26	14,181.26
应付销售服务	—	—	—	20,735.18	20,735.18

费					
应付交易费用	—	—	—	465.00	465.00
应付利息	—	—	—	27,592.61	27,592.61
其他负债	—	—	—	160,154.23	160,154.23
负债总计	42,063,945.70	—	—	596,830.16	42,660,775.86
利率敏感度缺口	-10,446,126.40	39,023,232.60	38,269,202.00	4,364,048.32	71,210,356.52
上年度末2013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	20,222,319.75	—	—	—	20,222,319.75
结算备付金	7,577,334.05	—	—	—	7,577,334.05
存出保证金	17,483.46	—	—	—	17,483.46
交易性金融资产	76,453,973.70	259,164,291.81	222,334,728.71	—	557,952,994.22
买入返售金融资产	800,000.00	—	—	—	800,000.00
应收证券清算款	—	—	—	18,936,745.05	18,936,745.05
应收利息	—	—	—	17,494,981.27	17,494,981.27
资产总计	105,071,110.96	259,164,291.81	222,334,728.71	36,431,726.32	623,001,857.80
负债					
卖出回购金融资产款	209,803,615.10	—	—	—	209,803,615.10
应付证券清算款	—	—	—	38,531,649.60	38,531,649.60
应付赎回款	—	—	—	1,877,740.22	1,877,740.22

应付管理人报酬	—	—	—	256,416.17	256,416.17
应付托管费	—	—	—	73,261.77	73,261.77
应付销售服务费	—	—	—	30,741.80	30,741.80
应付交易费用	—	—	—	2,139.01	2,139.01
应付利息	—	—	—	254,500.89	254,500.89
其他负债	—	—	—	200,775.80	200,775.80
负债总计	209,803,615.10	—	—	41,227,225.26	251,030,840.36
利率敏感度缺口	-104,732,504.14	259,164,291.81	222,334,728.71	-4,795,498.94	371,971,017.44

7.4.13.4.1.2 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 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
	1.利率下降25个基点	671,358.24	4,435,235.18
	2.利率上升25个基点	-679,618.86	-4,383,657.39

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日		上年度末 2013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	—	—	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	100,197,878.43	140.71	557,952,994.22	150.00
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	100,197,878.43	140.71	557,952,994.22	150.00

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准的公允价值发生变化，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 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
1.业绩比较基准的公允价值上升5%。		1,790,615.02	43,134,715.42
2.业绩比较基准的公允价值下降5%。		-1,790,615.02	-43,134,715.42

注：无

7.4.14 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	100,197,878.43	87.99
	其中：债券	100,197,878.43	87.99
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	8,695,413.00	7.64
7	其他各项资产	4,977,840.95	4.37
8	合计	113,871,132.38	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末（2014年12月31日），本基金未持有股票。

8.3 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

注：报告期末（2014年12月31日），本基金未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

注：报告期内（2014年1月1日至2014年12月31日），本基金未持有股票。

8.4.2 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

注：报告期内（2014年1月1日至2014年12月31日），本基金未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：报告期内（2014年1月1日至2014年12月31日），本基金未持有股票。

8.5 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	4,910,000.00	6.90
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,003,000.00	2.81
	其中：政策性金融债	2,003,000.00	2.81
4	企业债券	83,283,878.43	116.95
5	企业短期融资券	10,001,000.00	14.04
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	100,197,878.43	140.71

8.6 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	041460083	14皖建工CP001	100,000	10,001,000.00	14.04
2	124280	13通经开	100,000	9,880,000.00	13.87
3	122125	11美兰债	76,340	8,091,276.60	11.36
4	122132	12鹏博债	65,000	6,745,050.00	9.47
5	112069	12明牌债	60,000	6,108,000.00	8.58

8.7 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

本报告期末（2014年12月31日），本基金未持有资产支持证券。

8.8 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

报告期内（2014年1月1日至2014年12月31日），本基金未持贵金属。

8.9 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

报告期末（2014年12月31日），本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末（2014年12月31日），本基金无股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

《证券投资基金参与估值期货交易指引》（中国证监会公告【2010】13号）规定债券型基金不得参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

报告期末（2014年12月31日），本基金无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末（2014年12月31日），本基金无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

报告期末（2014年12月31日），本基金无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

2014年1月23日，12鹏博债（122132）的发行主体鹏博士电信传媒集团股份有限公司（以下简称“鹏博士”）的两大股东北京通灵电讯技术有限公司和上海秦砖投资管理有限公司因未及时对其一致行动关系及相关权益变动进行信息披露，受到上交所对上述两大股东的通报批评。2014年10月24日，鹏博士由于公司披露的2011、2012、2013年年度财务报告中现金流量表及补充资料的数据存在错误，收到证监会四川监管局《关于对鹏博士电信传媒集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（行政监管措施决定书[2014]15号）。鹏博士在收到警示函后，组织对相关财务信息进行更正，并于2014年10月31日公布了关于执行落实证监会四川监管局《关于对电信传媒集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》的整改报告。我们认为，上述监管措施未对其长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本期内未发现本基金投资的前十名证券的其他发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本基金本报告期内未持有股票。

8.12.3 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	16,962.47
2	应收证券清算款	1,999,994.90
3	应收股利	—
4	应收利息	2,960,883.58
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,977,840.95

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 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)	人均持有的 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

英大纯债债券A	254	61,010.84	—	—	15,496,754.16	100.00%
英大纯债债券C	155	324,519.93	37,307,278.38	74.17%	12,993,310.62	25.83%
合计	409	160,873.70	37,307,278.38	56.70%	28,490,064.78	43.30%

注：上表中持有人结构份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 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	英大纯债债券A	929.89	0.01%
	英大纯债债券C	—	—
	合计	929.89	—

注：本期末，本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。上表中基金管理人从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	英大纯债债券A	0
	英大纯债债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	英大纯债债券A	0
	英大纯债债券C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	英大纯债债券A	英大纯债债券C
基金合同生效日(2013年04月24日) 基金份额总额	811,221,644.46	684,062,967.94
本报告期期初基金份额总额	305,265,497.72	84,566,999.88
本报告期基金总申购份额	3,140,236.33	134,978,385.49
减：本报告期基金总赎回份额	292,908,979.89	169,244,796.37
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	15,496,754.16	50,300,589.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2014年6月5日发布公告，张传良董事长自2014年6月3日起不再代理总经理职务，杨峰先生自2014年6月3日起担任英大基金管理有限公司总经理职务。相关变更事项已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

本报告期内，基金管理人于2014年10月24日发布公告，张琳娜女士自2014年10月24日起担任英大基金管理有限公司英大纯债债券型证券投资基金基金经理。相关变更事项已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

本报告期内，基金管理人于2014年11月4日发布公告，李岚先生自2014年11月3日起不再担任英大基金管理有限公司英大纯债债券型证券投资基金基金经理。相关变更事项已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

本报告期内，基金托管人于2014年2月7日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

本报告期内，基金托管人于2014年11月03日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3 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、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为本基金审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用人民币60,000元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	—	—	—	—	0

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
中信证券	1,028,910,310.80	100.00%	5,590,589,000.00	100.00%	—	—

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 公司财务状况良好，经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iii 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究质量评价进行评估：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的行业研究的前瞻性、深度及广度进行评估，初步划定范围；

ii 对交易单元候选券商的研究服务进行评估：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和服务效果进行估，确定选用交易单元的券商。

iii 协议签署及通知托管人 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本表"佣金"指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易合计支付该等券商的佣金合计。

11.8 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	《英大纯债债券型证券投资基金招募说明书》、《英大纯债债券型证券投资基金发售公告》、《英大纯债债券型证券投资基金合同摘要》	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-03-18
2	《英大纯债债券型证券投资基金合同》、《英大纯债债券型证券投资基金托管协议》	公司网站	2013-03-18
3	英大纯债债券型证券投资基金新增和变更代销机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-03-21
4	英大基金管理有限公司开通网上交易业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-03-21
5	英大纯债债券型证券投资基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-03-25
6	英大纯债债券型证券投资基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-04-01
7	英大纯债债券型证券投资基金信息变更和更正公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-04-19
8	英大纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-04-25
9	英大纯债债券型证券投资基金2013年4月26日净值公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-04-26
10	英大纯债债券型证券投资基金2013年5月3日净值公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-05-03
11	英大纯债债券型证券投资基金	中国证监会指定报刊及公	2013-05-10

	2013年5月10日净值公告	司网站	
12	英大纯债债券型证券投资基金 2013年5月17日净值公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-05-17
13	英大纯债开放申购赎回业务的公 告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-05-23
14	英大纯债投资中小企业私募债的 公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-05-24
15	英大纯债定额定投及费率优惠公 告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-05-28
16	英大纯债关于增加代销机构并实 行申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-06-07
17	英大基金管理有限公司关于高管 人员变更的公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-06-13
18	英大基金管理有限公司关于增加 中期时代基金销售(北京)有限公 司为旗下基金代销机构并实行申 购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-06-14
19	关于增加中期时代基金销售(北 京)有限公司为英大纯债债券型 证券投资基金C类代销机构的公 告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-06-26
20	关于增加深圳众禄基金销售有限 公司为英大纯债债券型证券投资 基金C类代销机构的公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-06-28
21	关于增加杭州数米基金销售有限 公司为英大纯债债券型证券投资 基金C类代销机构的公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-06-28
22	英大基金管理有限公司关于增加 天天基金网为旗下基金代销机构 并实行申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-06-28
23	英大基金管理有限公司关于增加 上海好买基金销售有限公司为旗 下基金代销机构并实行申购费率	中国证监会指定报刊及公 司网站	2013-06-28

	优惠的公告		
24	英大纯债债券型证券投资基金半年度最后一个市场自然日净值公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-07-01
25	英大基金管理有限公司关于增加和讯理财客为旗下基金代销机构并实行申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-07-11
26	英大纯债债券型证券投资基金第二季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-07-18
27	关于增加北京展恒基金销售有限公司为英大纯债债券型证券投资基金C类代销机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-07-19
28	英大纯债债券型证券投资基金2013年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-08-28
29	英大基金管理有限公司变更董事长、总经理公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-09-10
30	英大纯债债券型证券投资基金变更基金经理公司	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-09-10
31	英大基金管理有限公司变更法定代表人公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-09-11
32	英大纯债债券型证券投资基金2013年第三季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-10-25
33	英大基金管理有限公司关于增加增财基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2013-12-12
34	英大纯债年度最后一个市场交易日净值公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2014-01-02
35	英大纯债债券型证券投资基金2013年第4季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2014-01-21
36	英大纯债债券型证券投资基金更换会计师事务所的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2014-03-20
37	英大纯债债券型证券投资基金2013年年度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2014-03-28

38	英大纯债债券型证券投资基金 2014年第1季度报告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2014-04-19
39	英大基金管理有限公司关于总经 理变更的公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2014-06-05
40	英大纯债债券型证券投资基金招 募说明书更新及摘要	中国证监会指定报刊及公 司网站	2014-06-07
41	英大纯债债券型证券投资基金半 年度最后一个市场交易日净值公 告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2014-07-01
42	英大纯债债券型证券投资基金 2014年第2季度报告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2014-07-21
43	英大纯债债券型证券投资基金 2014年半年度报告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2014-08-27
44	英大基金管理有限公司关于增聘 基金经理的公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2014-10-24
45	英大纯债债券型证券投资基金 2014年第3季度报告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2014-10-25
46	英大基金管理有限公司关于变更 基金经理的公告	中国证监会指定报刊及公 司网站	2014-11-04

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，因市场波动导致本基金净值发生波动，致使本基金持有单只债券的持仓比例被动超过10%。上述情况发生后，公司在征得监管机构和托管银行的理解和同意后，积极应对，将该指标调整到了合规水平。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

中国证监会批准英大纯债债券型证券投资基金设立的文件；
英大纯债债券型证券投资基金基金合同；
英大纯债债券型证券投资基金招募说明书；
英大纯债债券型证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件和营业执照；

报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

13.3 查阅方式

1.书面查阅：查阅时间为每工作日8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：<http://www.ydamc.com>

英大基金管理有限公司
二〇一五年三月二十七日