

英大纯债债券型证券投资基金2015年半年度报告

2015年06月30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08月28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。本半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8月26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2015年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

| | | |
|-----|---|----|
| §1 | 重要提示及目录 | 2 |
| §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 | 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| | 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| | 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §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 | 10 |
| | 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 | 11 |
| | 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| §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 | 12 |
| | 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| §6 | 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| | 6.1 资产负债表 | 12 |
| | 6.2 利润表 | 14 |
| | 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 15 |
| | 6.4 报表附注 | 16 |
| §7 | 投资组合报告 | 33 |
| | 7.1 期末基金资产组合情况 | 33 |
| | 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 33 |
| | 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 | 33 |
| | 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 34 |
| | 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 34 |
| | 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 | 34 |
| | 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 | 35 |
| | 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 | 35 |
| | 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 | 35 |
| | 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 35 |
| | 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 35 |
| | 7.12 投资组合报告附注 | 35 |
| §8 | 基金份额持有人信息 | 36 |
| | 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 36 |
| | 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 | 37 |
| §9 | 开放式基金份额变动 | 37 |
| §10 | 重大事件揭示 | 37 |
| | 10.1 基金份额持有人大会决议 | 37 |
| | 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 | 37 |
| | 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 38 |
| | 10.4 基金投资策略的改变 | 38 |
| | 10.5 基金改聘会计师事务所情况 | 38 |

| | | |
|------|-----------------------------------|----|
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况..... | 38 |
| 10.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 38 |
| 10.8 | 其他重大事件..... | 39 |
| §11 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 39 |
| §12 | 备查文件目录..... | 39 |
| 12.1 | 备查文件目录..... | 39 |
| 12.2 | 存放地点..... | 39 |
| 12.3 | 查阅方式..... | 40 |

§ 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 | |
| 交易代码 | | |
| 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 | 32,346,090.67 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 英大纯债债券A | 英大纯债债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 650001 | 650002 |
| 报告期末下属两级基金的份 额总额 | 6,671,737.83 | 25,674,352.84 |

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 |
| 信息披露负责 姓名 | 张宁 | 田青 |

| | | | |
|--------|------|------------------------------|----------------------|
| 人 | 联系电话 | 010-59112066 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | zhangning@ydamc.com | tianqingl.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》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ydamc.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|------------------------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

| | 本期 | |
|---------------|-------------------------|--------------|
| | 2015年01月01日-2015年06月30日 | |
| 3.1.1 期间数据和指标 | 英大纯债债券A | 英大纯债债券C |
| 本期已实现收益 | 936,658.93 | 2,934,092.02 |
| 本期利润 | 760,966.79 | 2,365,930.01 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0684 | 0.0649 |

| | | |
|---------------|-------------------------------|---------------|
| 本期基金加权平均净值利润率 | 6.11% | 5.82% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.15% | 5.92% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 本期 2015年01月01日-2015年06月30日 | |
| 期末可供分配利润 | 758,252.95 | 2,632,985.78 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1137 | 0.1026 |
| 期末基金资产净值 | 7,709,394.61 | 29,378,718.97 |
| 期末基金份额净值 | 1.1555 | 1.1443 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 本期 2015年01月01日-2015年06月30日 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 15.55% | 14.43% |

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 |
|--------------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.12% | 0.06% | -0.08% | 0.05% | 0.20% | 0.01% |
| 过去三个月 | 3.14% | 0.08% | 1.35% | 0.10% | 1.79% | -0.02% |
| 过去六个月 | 6.15% | 0.11% | 1.20% | 0.10% | 4.95% | 0.01% |
| 过去一年 | 14.71% | 0.17% | 3.60% | 0.11% | 11.11% | 0.06% |
| 自基金合同生效日起至今（2013年04月24日-2015年06月30日） | 15.55% | 0.17% | 2.73% | 0.10% | 12.82% | 0.07% |

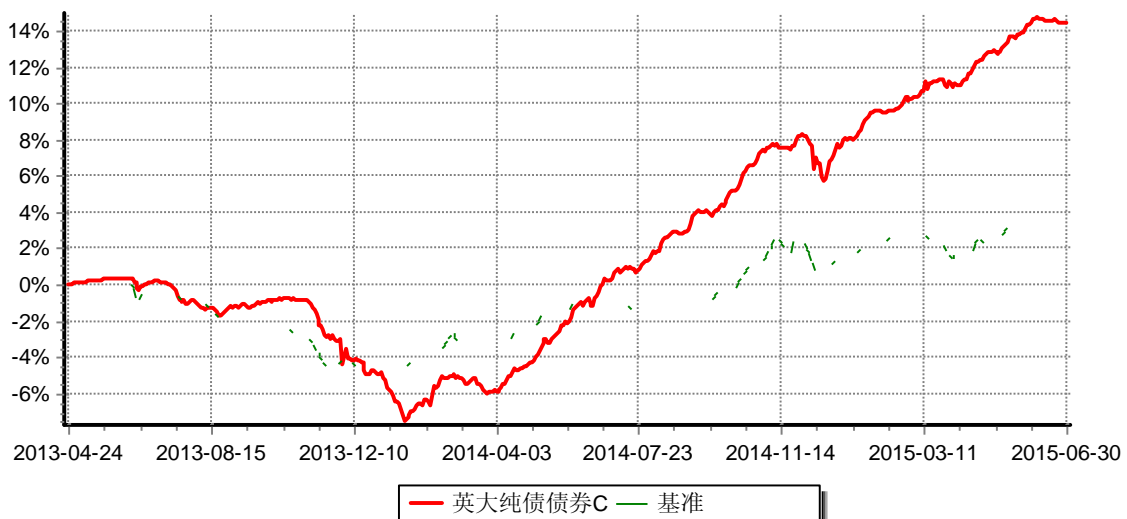
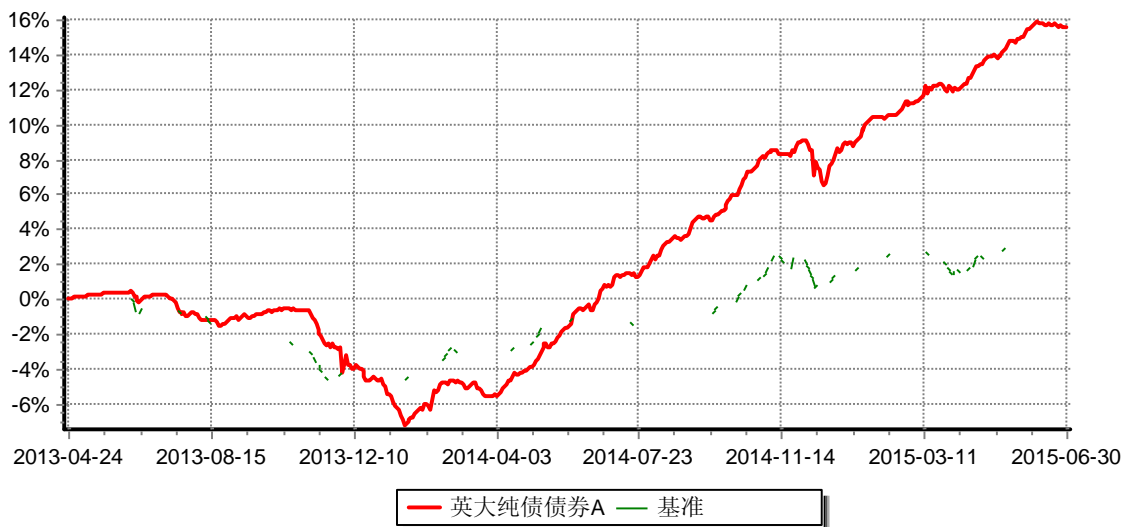
注：本基金合同于2013年4月24日生效

| 阶段 (英大纯债债券C) | 份额净值增长 | 份额净值增长 | 业绩比较基准 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|-----------------|--------|--------|--------|--------|-----|-----|
|-----------------|--------|--------|--------|--------|-----|-----|

| | 率① | 率标准 差② | 收益率 ③ | 收益率 标准差 ④ | | |
|--|--------|-----------|----------|-----------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.10% | 0.06% | -0.08% | 0.05% | 0.18% | 0.01% |
| 过去三个月 | 3.03% | 0.08% | 1.35% | 0.10% | 1.68% | -0.02% |
| 过去六个月 | 5.92% | 0.11% | 1.20% | 0.10% | 4.72% | 0.01% |
| 过去一年 | 14.20% | 0.17% | 3.60% | 0.11% | 10.60% | 0.06% |
| 自基金合同生效日起 至今（2013年04月24 日-2015年06月30日） | 14.43% | 0.17% | 2.73% | 0.10% | 11.70% | 0.07% |

注：本基金合同于2013年4月24日生效

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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%。

截止2015年6月30日，本公司管理4只开放式证券投资基金，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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------------------|-------------|-------------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘熹 | 本基金的基金经理、公司总经理助理 | 2013年04月24日 | 2013年09月09日 | 13 | 经济学硕士。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，现任英大基金管理有限公司总经理助理。 |
| 李岚 | 本基金基金经理 | 2013年09月09日 | 2014年11月03日 | 7 | 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 | — | 9 | 对外经济贸易大学金融学硕士，9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。 |
|-----|---------|-------------|---|---|---|

注：①任职日期说明：刘熹的任职日期为基金合同生效的日期。

②证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

③本基金无基金经理助理。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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 公平交易制度的执行情况

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》及公司内部相关制度规定，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非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年短端债券下行较多，而长端利率以震荡为主。央行降息降准齐发，在资金面无忧的情况下，市场对宏观经济是否企稳仍存分歧，叠加万亿级别地方政府债置换供给持续增多，导致长端债券震荡无明显方向。

本基金在2015年上半年增加了短久期债券的配置，进一步缩短组合久期，增加了组合的防御性，并排查了持仓债券的信用风险。

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1.1555元，报告期基金份额净值增长率为6.15%；英大纯债C类基金份额净值为1.1443元，报告期基金份额净值增长率为5.92%；同期业绩比较基准增长率1.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股市对债券行情的影响由正转负，虽然风险偏好的下降带来了债券市场的一波行情，但是很快长端债券重回震荡通道，短期事件性影响较快恢复，债券市场的走势仍旧由基本面来决定。展望2015年下半年，地方政府债置换继续，基建投资的扩大、一带一路的推进都为国内萎缩的消费提供对冲，一线城市房地产市场有所企稳，但是二三线城市库存较大消化时间较长，处于转型期的中国，未来面临的挑战巨大，对宏观经济数据的判断加大，而资金面的持续宽松为杠杆操作提供了空间，本基金将继续保持稳健的风格，适度增加久期，力争为持有人持续实现正收益。

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历。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期末进行收益分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2015年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2015年06月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 442,749.41 | 8,080,850.57 |
| 结算备付金 | | 355,557.12 | 614,562.43 |
| 存出保证金 | | 3,504.89 | 16,962.47 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 57,512,335.80 | 100,197,878.43 |
| 其中：股票投资 | | — | — |
| 基金投资 | | — | — |
| 债券投资 | | 57,512,335.80 | 100,197,878.43 |
| 资产支持证券投资 | | — | — |

| | | | |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 贵金属投资 | | — | — |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | — | — |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | — | — |
| 应收证券清算款 | | 1,298,464.09 | 1,999,994.90 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,008,195.44 | 2,960,883.58 |
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | 642,345.00 | — |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | | 11,264.70 | — |
| 资产总计 | | 61,274,416.45 | 113,871,132.38 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015年06月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | — | — |
| 交易性金融负债 | | — | — |
| 衍生金融负债 | | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | | 22,458,979.40 | 42,063,945.70 |
| 应付证券清算款 | | 1,229,214.59 | 7,546.87 |
| 应付赎回款 | | 283,943.23 | 316,520.48 |
| 应付管理人报酬 | | 26,180.94 | 49,634.53 |
| 应付托管费 | | 7,480.27 | 14,181.26 |
| 应付销售服务费 | | 12,291.48 | 20,735.18 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.6 | 412.50 | 465.00 |
| 应交税费 | | — | — |
| 应付利息 | | 14,872.95 | 27,592.61 |
| 应付利润 | | — | — |
| 递延所得税负债 | | — | — |
| 其他负债 | 6.4.7.7 | 152,927.51 | 160,154.23 |
| 负债合计 | | 24,186,302.87 | 42,660,775.86 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.8 | 32,346,090.67 | 65,797,343.16 |
| 未分配利润 | 6.4.7.9 | 4,742,022.91 | 5,413,013.36 |
| 所有者权益合计 | | 37,088,113.58 | 71,210,356.52 |

| | | | |
|------------|--|---------------|----------------|
| 负债和所有者权益总计 | | 61,274,416.45 | 113,871,132.38 |
|------------|--|---------------|----------------|

注：①报告截止日2015年6月30日，英大纯债债券A基金份额净值1.1555元，基金份额总额6,671,737.83份；英大纯债债券C基金份额净值1.1443元，基金份额总额25,674,352.84份。英大纯债债券基金份额总额合计为32,346,090.67份。

6.2 利润表

会计主体：英大纯债债券型证券投资基金

本报告期：2015年01月01日-2015年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015年01月01日-2015 年06月30日 | 上年度可比期间2014 年01月01日-2014年06 月30日 |
|-----------------|----------------|-----------------------------------|--|
| 一、收入 | | 3,953,489.87 | 17,025,795.20 |
| 1. 利息收入 | | 2,471,803.76 | 14,113,755.12 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7 .10 | 11,032.26 | 60,297.26 |
| 债券利息收入 | | 2,445,358.00 | 14,029,501.97 |
| 资产支持证券利息收入 | | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | | 15,413.50 | 23,955.89 |
| 其他利息收入 | | — | — |
| 2. 投资收益 | | 2,209,506.88 | -23,549,245.63 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7 .11 | — | — |
| 基金投资收益 | | — | — |
| 债券投资收益 | 6.4.7 .12 | 2,209,506.88 | -23,549,245.63 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7 .12.5 | — | — |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7 .13 | — | — |
| 衍生工具收益 | 6.4.7 .14 | — | — |
| 股利收益 | 6.4.7 .15 | — | — |
| 3. 公允价值变动收益 | 6.4.7 .16 | -743,854.15 | 26,425,748.03 |
| 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 .17 | 16,033.38 | 35,537.68 |
| 减: 二、费用 | | 826,593.07 | 4,771,142.59 |
| 1. 管理人报酬 | | 184,978.36 | 1,008,077.58 |
| 2. 托管费 | | 52,850.97 | 288,022.15 |
| 3. 销售服务费 | | 80,720.07 | 117,911.99 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7 .18 | 1,277.44 | 7,556.53 |
| 5. 利息支出 | | 398,372.70 | 3,259,602.26 |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | 398,372.70 | 3,259,602.26 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7 .19 | 108,393.53 | 89,972.08 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 3,126,896.80 | 12,254,652.61 |
| 减: 所得税费用 | | — | — |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 3,126,896.80 | 12,254,652.61 |

6.3 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: 2015年01月01日-2015年06月30日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2015年01月01日-2015年06月30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) | 65,797,343.16 | 5,413,013.36 | 71,210,356.52 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | 3,126,896.80 | 3,126,896.80 |
| 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) | -33,451,252.49 | -3,797,887.25 | -37,249,139.74 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 26,737,487.41 | 2,954,054.81 | 29,691,542.22 |
| 2. 基金赎回款 | -60,188,739.90 | -6,751,942.06 | -66,940,681.96 |

| | | | |
|--|------------------------------------|----------------|-----------------|
| 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) | 32,346,090.67 | 4,742,022.91 | 37,088,113.58 |
| 项目 | 上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30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) | — | 12,254,652.61 | 12,254,652.61 |
| 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) | -176,965,885.41 | 6,811,095.78 | -170,154,789.63 |
| 其中：1. 基金申购款 | 29,463,333.27 | -665,423.95 | 28,797,909.32 |
| 2. 基金赎回款 | -206,429,218.68 | 7,476,519.73 | -198,952,698.95 |
| 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) | 212,866,612.19 | 1,204,268.23 | 214,070,880.42 |

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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/申购的基金分类别。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%。

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于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38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”）、中国证监会于2013年5月17日发布的《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〉》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》以及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2015年6月30日的财务状况以及2015年上半年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

除6.4.5.2会计估计变更的说明中所列的会计估计变更事项外，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。

会计估计变更详见6.4.5.2会计估计变更的说明。

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

本基金本报告期间不涉及会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自2015年3月25日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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) 根据财政部、国家税务总局、证监会财税[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》的规定，自2013年1月1日起，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

| 项目 | 本期末 2015年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款 | 442,749.41 |
| 定期存款 | — |
| 其中：存款期限1-3个月 | — |
| 其他存款 | — |
| 合计 | 442,749.41 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2015年06月30日 | | |
|---------------|----------------|---------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票 | — | — | — |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | — | — | — |
| 债券 | 交易所市场 | 44,041,900.73 | 387,935.07 |
| | 银行间市场 | 13,005,348.09 | 77,151.91 |
| | 合计 | 57,047,248.82 | 465,086.98 |
| 资产支持证券 | — | — | — |
| 其他 | — | — | — |
| 合计 | 57,047,248.82 | 57,512,335.80 | 465,086.98 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2015年6月30日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末（2015年6月30日），本基金未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2015年6月30日），本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末:2015年06月30日 |
|----|-----------------|
|----|-----------------|

| | |
|------------|--------------|
| 应收活期存款利息 | 294.69 |
| 应收定期存款利息 | — |
| 应收其他存款利息 | — |
| 应收结算备付金利息 | 160.00 |
| 应收债券利息 | 1,007,324.65 |
| 应收买入返售证券利息 | — |
| 应收申购款利息 | 414.50 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | — |
| 其他 | 1.60 |
| 合计 | 1,008,195.44 |

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年06月30日 |
|-------------|-----------------|
| 交易所市场应付交易费用 | — |
| 银行间市场应付交易费用 | 412.50 |
| 合计 | 412.50 |

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | — |
| 应付赎回费 | 151.78 |
| 会计师费 | 89,752.78 |
| 信息披露费 | 49,588.57 |
| 银行间账户维护费 | 13,434.38 |
| 合计 | 152,927.51 |

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 (英大纯债债券A) | 本期 2015年01月01日-2015年06月30日 | |
|-----------------|----------------------------|---------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 15,496,754.16 | 15,496,754.16 |

| | | |
|-----------------|----------------|----------------|
| 本期申购 | 5,120,622.88 | 5,120,622.88 |
| 本期赎回 | -13,945,639.21 | -13,945,639.21 |
| 期末数 | 6,671,737.83 | 6,671,737.83 |
| 项目 (英大纯债债券C) | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 50,300,589.00 | 50,300,589.00 |
| 本期申购 | 21,616,864.53 | 21,616,864.53 |
| 本期赎回 | -46,243,100.69 | -46,243,100.69 |
| 期末数 | 25,674,352.84 | 25,674,352.84 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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 | 424,495.76 | 948,900.79 | 1,373,396.55 |
| 本期利润 | 936,658.93 | -175,692.14 | 760,966.79 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -602,901.74 | -493,804.82 | -1,096,706.56 |
| 其中：基金申购款 | 303,366.36 | 286,912.72 | 590,279.08 |
| 基金赎回款 | -906,268.10 | -780,717.54 | -1,686,985.64 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | 758,252.95 | 279,403.83 | 1,037,656.78 |

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 | 975,765.22 | 3,063,851.59 | 4,039,616.81 |
| 本期利润 | 2,934,092.02 | -568,162.01 | 2,365,930.01 |
| 本期基金份额交易产生的变 | -1,276,871.46 | -1,424,309 | -2,701,180.69 |

| | | | |
|----------|------------------|----------------------|------------------|
| 动数 | | . 23 | |
| 其中：基金申购款 | 1, 207, 148. 72 | 1, 156, 627. 01 | 2, 363, 775. 73 |
| 基金赎回款 | -2, 484, 020. 18 | -2, 580, 936 . 24 | -5, 064, 956. 42 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | 2, 632, 985. 78 | 1, 071, 380. 35 | 3, 704, 366. 13 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年01月01日-2015年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 6, 359. 34 |
| 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 | 4, 348. 59 |
| 其他 | 324. 33 |
| 合计 | 11, 032. 26 |

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年01月01日-2015年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | — |
| 减：卖出股票成本总额 | — |
| 买卖股票差价收入 | — |

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年01月01日-2015年06月30日 |
|----|-------------------------------|
|----|-------------------------------|

| | |
|-------------------------|---------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 75,179,969.65 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 70,522,889.85 |
| 减：应收利息总额 | 2,447,572.92 |
| 买卖债券差价收入 | 2,209,506.88 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.12.3 债券投资收益——申购差价收入

本报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）无债券投资收益差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益

本报告期（2015年1月1日至2015年6月30日），本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期（2015年1月1日至2015年6月30日），本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本报告期（2015年1月1日至2015年6月30日），本基金无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2015年01月01日-2015年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -743,854.15 |
| ——股票投资 | — |
| ——债券投资 | -743,854.15 |
| ——资产支持证券投资 | — |
| ——贵金属投资 | — |
| 2. 衍生工具 | — |
| ——权证投资 | — |

| | |
|-------|-------------|
| 3. 其他 | — |
| 合计 | -743,854.15 |

注：当期发生的公允价值变动损失以“—”号填列

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2015年01月01日-2015年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 4,998.82 |
| 其他 | 11,034.56 |
| 合计 | 16,033.38 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2015年01月01日-2015年06月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 619.94 |
| 银行间市场交易费用 | 657.50 |
| 合计 | 1,277.44 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|-------------------------|
| | 2015年01月01日-2015年06月30日 |
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 49,588.57 |
| 数据证书费（乙类帐户） | 200.00 |
| 乙类帐户维护费 | 24,669.68 |
| 银行费用 | 4,182.50 |
| 其他 | — |
| 合计 | 108,393.53 |

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

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

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**

本基金本报告期不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。

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

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**

=本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.1.4 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.5 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

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

| 关联方名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------|----|---------|
|-------|----|---------|

| | 2015年01月01日-2015年06月30日 | 2014年01月01日-2014年06月30日 |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 184,978.36 | 1,008,077.58 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 30,698.97 | 98,045.56 |

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年01月01日-2015年06月30日 | 上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 52,850.97 | 288,022.15 |

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。

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 2015年01月01日-2015年06月30日 | | |
|----------------|--------------------------------|-----------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 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 | — | 8,428.18 | 8,428.18 |
| 中国建设银行股份有限公司 | — | 66,133.77 | 66,133.77 |
| 合计 | — | 74561.95 | 74561.95 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 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 | — | 8,928.09 | 8,928.09 |

| | | | |
|------------------|---|------------|------------|
| 司 | | | |
| 中国建设银行股份有 限公司 | — | 104,927.05 | 104,927.05 |
| 合计 | — | 113855.14 | 113855.14 |

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。

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。

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

本基金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。

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

本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

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 2015年01月01日-2015年06月30 日 | | 上年度可比期间 2014年01月01日-2014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 |
| 中国建设银行 股份有限公司 | 442,749.41 | 6,359.34 | 16,463,010.33 | 22,043.49 |

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）无利润分配事项。

6.4.12 期末（2015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

本基金本期末（2015年6月30日）未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末（2015年6月30日）未持有需披露的暂时停牌股票。

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2015年6月30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元。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015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22,458,979.4元，分别于2015年7月1日—7月28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。

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。

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，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。本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的债券，不得超过该债券的10%。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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一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，除在本报告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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2015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 | 442,749.41 | — | — | — | 442,749.41 |

| | | | | | |
|---------------------|---------------|---------------|--------------|--------------|---------------|
| 结算备付金 | 355,557.12 | — | — | — | 355,557.12 |
| 存出保证金 | 3,504.89 | — | — | — | 3,504.89 |
| 交易性金融资产 | 13,806,295.30 | 34,539,020.50 | 9,167,020.00 | — | 57,512,335.80 |
| 应收证券清算款 | — | — | — | 1,298,464.09 | 1,298,464.09 |
| 应收利息 | — | — | — | 1,008,195.44 | 1,008,195.44 |
| 应收申购款 | — | — | — | 642,345.00 | 642,345.00 |
| 其他资产 | — | — | — | 11,264.70 | 11,264.70 |
| 资产总计 | 14,608,106.72 | 34,539,020.50 | 9,167,020.00 | 2,960,269.23 | 61,274,416.45 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 22,458,979.40 | — | — | — | 22,458,979.40 |
| 应付证券清算款 | — | — | — | 1,229,214.59 | 1,229,214.59 |
| 应付赎回款 | — | — | — | 283,943.23 | 283,943.23 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | 26,180.94 | 26,180.94 |
| 应付托管费 | — | — | — | 7,480.27 | 7,480.27 |
| 应付销售服务费 | — | — | — | 12,291.48 | 12,291.48 |
| 应付交易费用 | — | — | — | 412.50 | 412.50 |
| 应付利息 | — | — | — | 14,872.95 | 14,872.95 |
| 其他负债 | — | — | — | 152,927.51 | 152,927.51 |
| 负债总计 | 22,458,979.40 | — | — | 1,727,323.47 | 24,186,302.87 |
| 利率敏感度缺口 | -7,850,872.68 | 34,539,020.50 | 9,167,020.00 | 1,232,945.76 | 37,088,113.58 |
| 上年度末 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 |
| 应付销售服务费 | — | — | — | 20,735.18 | 20,735.18 |
| 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 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | |
|----|--------------------|----------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 |

| | | 影响金额（单位：人民币元） | |
|--|-----------|--------------------|---------------------|
| | | 本期末 2015年06月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| | 利率下降25个基点 | 321,188.6000 | 671,358.2400 |
| | 利率上升25个基点 | -317,803.3800 | -679,618.8600 |

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年06月30日 | | 上年度末 2014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-债券投资 | 57,512,335.80 | 155.07 | 100197878.43 | 140.71 |
| 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 | 57,512,335.80 | 155.07 | 100197878.43 | 140.71 |
| 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 2015年06月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| | 1. 业绩比较基准的公允价值上升5% | 742,943.26 | 1,790,615.02 |
| | 2. 业绩比较基准的公允价值下降5% | -742,943.26 | -1,790,615.02 |

6.4.14 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。

§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 | 固定收益投资 | 57,512,335.80 | 93.86 |
| | 其中：债券 | 57,512,335.80 | 93.86 |
| | 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 | 798,306.53 | 1.30 |
| 6 | 其他资产 | 2,963,774.12 | 4.84 |
| 7 | 合计 | 61,274,416.45 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

报告期末（2015年6月30日），本基金未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

报告期末（2015年6月30日），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

报告期内（2015年1月1日至2015年6月30日），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

报告期内（2015年1月1日至2015年6月30日），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

报告期内（2015年1月1日至2015年6月30日），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 | 723,795.30 | 1.95 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 2,997,000.00 | 8.08 |
| | 其中：政策性金融债 | 2,997,000.00 | 8.08 |
| 4 | 企业债券 | 43,706,040.50 | 117.84 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,085,500.00 | 27.19 |
| 6 | 可转债 | — | — |
| 7 | 其他 | — | — |
| 8 | 合计 | 57,512,335.80 | 155.07 |

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 | 122125 | 11美兰债 | 51,000 | 5,505,960.00 | 14.85 |
| 2 | 112142 | 12格林债 | 52,000 | 5,468,840.00 | 14.75 |
| 3 | 122132 | 12鹏博债 | 52,000 | 5,452,200.00 | 14.70 |
| 4 | 112079 | 12长安债 | 51,000 | 5,283,600.00 | 14.25 |
| 5 | 112069 | 12明牌债 | 51,000 | 5,249,940.00 | 14.16 |

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

注：本报告期末（2015年6月30日），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

报告期末（2015年6月30日），本基金未持有贵金属投资。

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

注：报告期末（2015年6月30日），本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

《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。报告期末（2015年6月30日），本基金无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期末（2015年6月30日），本基金无股指期货投资。

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

报告期末（2015年6月30日），本基金无国债期货投资。

7.11.2 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（2015年6月30日），本基金无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

报告期末（2015年6月30日），本基金无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2014年10月24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”）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。2014年11月7日，鹏博士发布《关于大股东增持公司股份及误操作导致短线交易的公告》，公告中说明由于操作失误，鹏博士的大股东在增持公司股份过程中出现短线操作，违反了《证券法》及上海证券交易所的有关规定，但短线交易涉

及金额较小，且未产生收益。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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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 | 3,504.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,298,464.09 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 1,008,195.44 |
| 5 | 应收申购款 | 642,345.00 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | 11,264.70 |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 2,963,774.12 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末（2015年6月30日），本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末（2015年6月30日），本基金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

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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额 级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|--------------|---------------|----------|----------|----------|----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有 份额 | 占总份 额 | 持有 份额 | 占总份 额 |
| | | | | | | |

| | | | | 比例 | | 比例 |
|-------------|-----|------------|-------------------|--------|-------------------|---------|
| 英大纯 债债券A | 146 | 45,696.83 | — | — | 6,671,737. 83 | 100.00% |
| 英大纯 债债券C | 163 | 157,511.37 | 19,238,168 .53 | 74.93% | 6,436,184. 31 | 25.07% |
| 合计 | 309 | 104,679.91 | 19,238,168 .53 | 59.48% | 13,107,922 .14 | 40.52% |

注：①英大纯债债券A:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有英大纯债债券A份额占英大纯债债券A总份额比例、个人投资者持有英大纯债债券A份额占英大纯债债券A总份额比例。

②英大纯债债券C:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有英大纯债债券C份额占英大纯债债券C总份额比例、个人投资者持有英大纯债债券C份额占英大纯债债券C总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

§ 9 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 | 15,496,754.16 | 50,300,589.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,120,622.88 | 21,616,864.53 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 13,945,639.21 | 46,243,100.69 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 6,671,737.83 | 25,674,352.84 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 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。

10.5 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|-----------|---------------|-----------|----------------|-------------|------|-----------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占股票成交总额比例 | 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 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信证券 | 2 | — | — | 67,218,111.25 | 100.00% | 374,949,000.00 | 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评估，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。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 信息披露方式 | 披露日期 |
|----|-----------------------------------|----------------|------------|
| 1 | 英大纯债债券型证券投资基金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 | 2015-01-05 |
| 2 | 英大纯债债券型证券投资基金2014年第4季度报告 | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2015-01-21 |
| 3 | 英大纯债债券型证券投资基金2014年年度报告及摘要 | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2015-03-27 |
| 4 | 英大基金管理有限公司关于公司旗下基金固定收益品种估值方法调整的公告 | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2015-03-31 |
| 5 | 英大纯债债券型证券投资基金2015年第1季度报告 | 中国证监会指定报刊及公司网站 | 2015-04-22 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本公司旗下英大纯债债券型证券投资基金依据《基金部通知【2012】21号关于证券投资基金投资中小企业私募债券有关问题的通知》及相关公告文件，于2013年5月24日在公司网站及指定报刊发布了《英大基金管理有限公司关于旗下基金投资中小企业私募债券的公告》，该公告披露了英大纯债债券型证券投资基金投资的天津市朝日科贸有限公司2013年中小企业私募债券，数量共计20万张，期限为2年，收益率（票面利率）为10%。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日8:30-11:30, 13:00-17:00。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
二〇一五年八月二十八日