

英大纯债债券型证券投资基金

2015年第3季度报告

2015年09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

报告送出日期：2015年10月27日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月26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2015年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	57,037,132.63份
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。
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	
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	12,500,716.50份	44,536,416.13份

### § 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（2015年07月01日-2015年09月30日）	
	英大纯债债券A	英大纯债债券C
1. 本期已实现收益	127,337.24	485,277.88
2. 本期利润	245,052.77	922,494.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0288	0.0258
4. 期末基金资产净值	14,845,864.91	52,323,574.99
5. 期末基金份额净值	1.1876	1.1748

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 本报告期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

英大纯债债券A

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	2.78%	0.08%	1.12%	0.06%	1.66%	0.02%

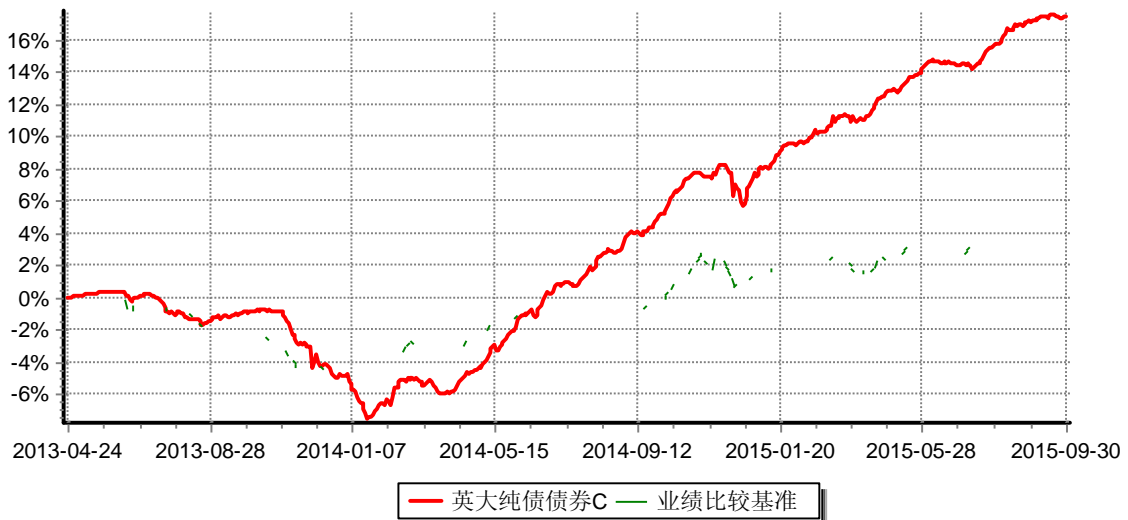
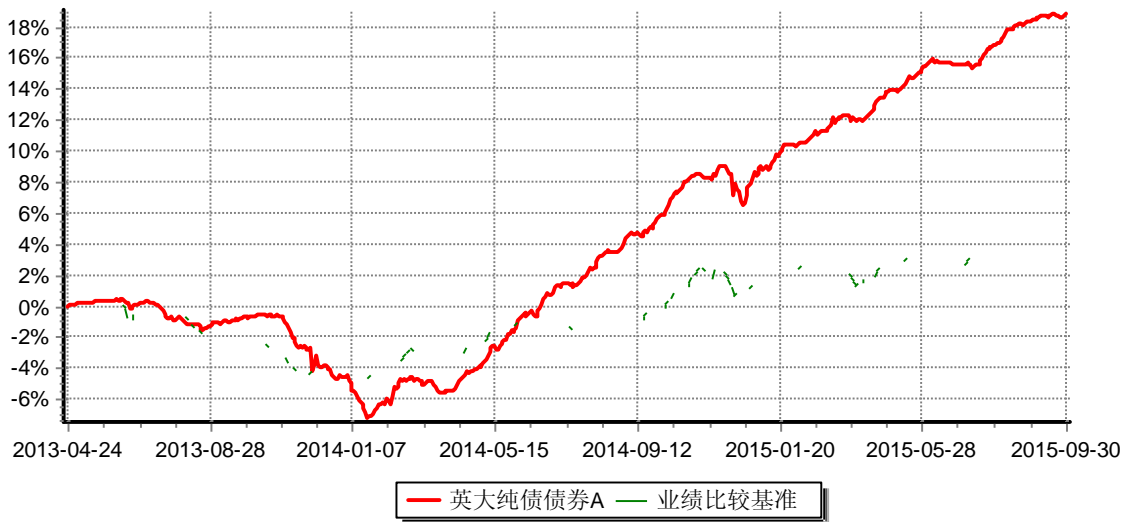
英大纯债债券C

阶段	净值增	净值增	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

	长率①	长率标 准差②	较基准 收益率 ③	较基准 收益率 标准差 ④		
过去三个月	2.67%	0.08%	1.12%	0.06%	1.55%	0.02%

注：本基金的业绩比较基准是中债综合指数。

### 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



## § 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		
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	曾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	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：注：①任职日期说明：首位基金经理的任职日期为基金合同生效的日期，继任基金经理的任职日期为该基金经理经监管机构审核通过后公司公开披露的日期。

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。

## 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《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 公平交易专项说明

### 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《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，通过公司新上线的公平交易系统监测和人工复核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不公平交易的情况。

### 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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年三季度债市收益率震荡下行，十年国债季度末比季度初下行36BP，一年期存款利率下调25BP至1.75%，存款准备金率下调50基点。三季度大宗商品价格走弱及美联储加息预期的存在使得美元走强，人民币汇率贬值压力使得国内债券市场资金面受到了一定冲击，央行采用降准降息、公开市场操作和各种定向操作工具对冲人民币汇率贬值的影响，资金面经历了季度初的极度宽松至季度末稳定偏紧的过程。宏观经济继续下滑叠加美联储加息的延后，长端收益率从全年来看本季度下行较多。

因此本基金在三季度小幅增加了长久期债券的配置，但幅度不及申购的速度，有所

稀释组合收益，同时组合杠杆下降较多。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，英大纯债A类基金累计份额净值为1.1876元，报告期基金份额净值增长率为2.78%；英大纯债C类基金累计份额净值为1.1748元，报告期基金份额净值增长率为2.67%；同期业绩比较基准增长率为1.12%。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2015年四季度，美联储一再推迟加息，使得市场一直存在加息预期，而国内的宏观经济一路走低，调结构的阵痛远未结束，市场对经济的企稳仍旧存有预期，股市和IPO以及外汇市场对资金面的冲击时好时坏，虽然不确定性在2015年一直左右着市场的走势，但是市场终究会回归基本面，GDP大概率不会高于7，CPI在2附近徘徊，宏观经济不起，资金面宽松不及上半年但政策宽松不会退出，四季度是全年资金波动的关键季度。

因此，2015年四季度，本基金将继续适度增加久期，并提高杠杆水平，以谨慎的心态持续关注全球和国内经济形势，保持稳健的风格，力争为持有人持续实现正收益。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	72,890,038.40	94.87
	其中：债券	72,890,038.40	94.87
	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	951,774.89	1.24
8	其他资产	2,991,756.09	3.89
9	合计	76,833,569.38	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告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	6,745,350.00	10.04
2	央行票据	—	—
3	金融债券	3,003,000.00	4.47
	其中：政策性金融债	3,003,000.00	4.47
4	企业债券	53,011,188.40	78.92
5	企业短期融资券	10,130,500.00	15.08
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	72,890,038.40	108.52

## 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

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	112142	12格林债	55,010	5,847,563.00	8.71
2	122125	11美兰债	51,000	5,583,990.00	8.31
3	112079	12长安债	51,000	5,279,010.00	7.86
4	122132	12鹏博债	49,000	5,154,310.00	7.67
5	112069	12明牌债	49,000	5,104,820.00	7.60

#### 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货的投资。

#### 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本期内本基金没有股票投资。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,713.77
2	应收证券清算款	1,000,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	1,880,204.43
5	应收申购款	104,206.35
6	其他应收款	—
7	待摊费用	5,631.54
8	其他	—
9	合计	2,991,756.09

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

	英大纯债债券A	英大纯债债券C

报告期期初基金份额总额	6,671,737.83	25,674,352.84
报告期期间基金总申购份额	7,097,292.96	35,773,525.05
减：报告期期间基金总赎回份额	1,268,314.29	16,911,461.76
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	—	—
报告期期末基金份额总额	12,500,716.50	44,536,416.13

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

## § 8 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

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托管协议》

基金管理人业务资格批件和营业执照

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/或基金托管人住所

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

英大基金管理有限公司  
二〇一五年十月二十七日