

英大纯债债券型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 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：2016 年 8 月 25 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2016年8月24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2016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
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
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	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
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.....	35
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.....	35
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.....	36
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.11 投资组合报告附注.....	36
§8 基金份额持有人信息	37

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	37
§9 开放式基金份额变动.....	38
§10 重大事件揭示.....	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	41
§12 备查文件目录.....	41
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点.....	41
12.3 查阅方式.....	41

§ 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4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	231,357,966.76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	144,830,933.32份	86,527,033.44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	
信息披露负责人	姓名	宗宽广	田青
	联系电话	010-59112066	010-67595096
	电子邮箱	zongkg@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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	

	2201	
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	http://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

金额单位：人民币元

基金级别	英大纯债债券 A	英大纯债债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,957,796.52	621,576.70
本期利润	1,652,049.53	573,074.50
加权平均基金份额本期利润	0.0193	0.0190
本期加权平均净值利润率	1.74%	1.77%
本期基金份额净值增长率	4.13%	2.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	9,396,512.63	2,496,216.59
期末可供分配基金份额利润	0.0649	0.0288
期末基金资产净值	160,041,720.57	92,502,846.52
期末基金份额净值	1.1050	1.0691
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	25.52%	21.64%

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

英大纯债债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.39%	0.02%	0.36%	0.04%	0.03%	-0.02%
过去三个月	0.68%	0.03%	-0.52%	0.07%	1.20%	-0.04%
过去六个月	4.13%	0.17%	-0.21%	0.07%	4.34%	0.10%
过去一年	8.63%	0.13%	2.74%	0.07%	5.89%	0.06%
过去三年	25.38%	0.17%	5.74%	0.09%	19.64%	0.08%
自基金合同生效起至今	25.52%	0.16%	5.55%	0.10%	19.97%	0.06%

英大纯债债券 C

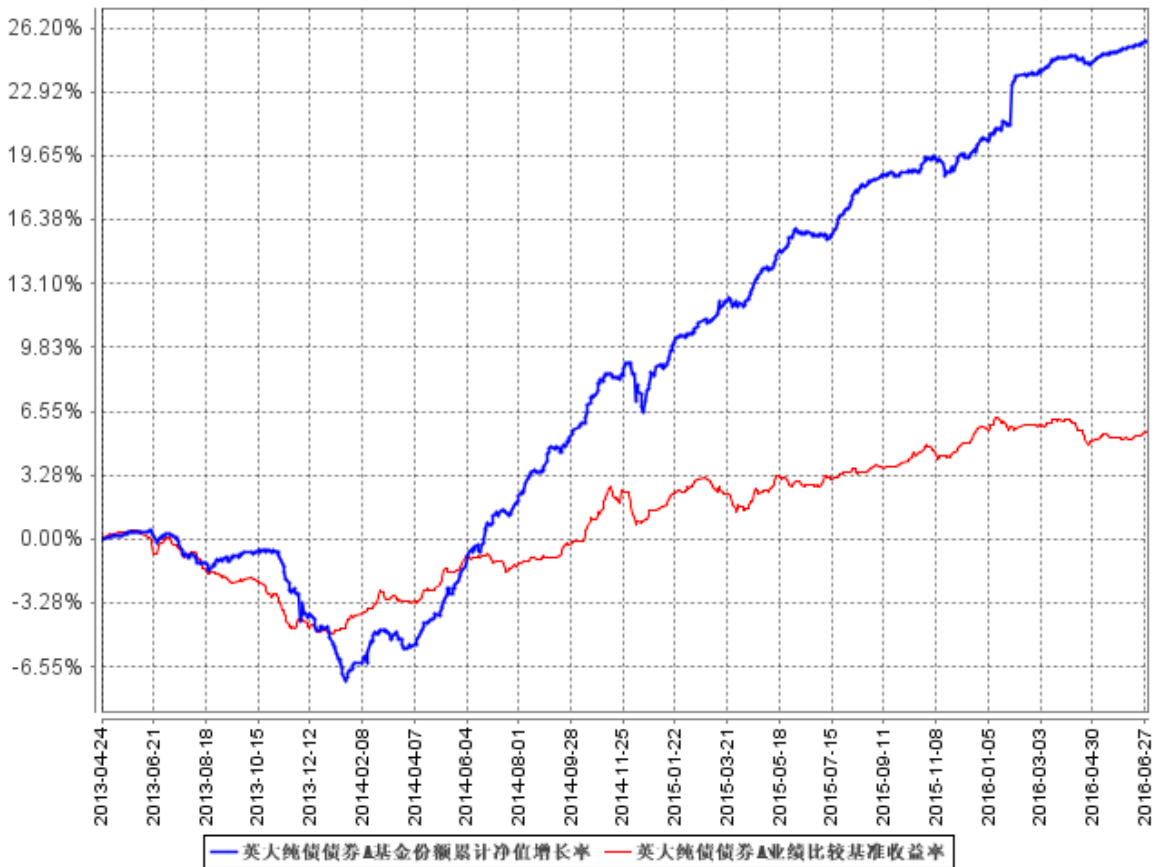
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.36%	0.02%	0.36%	0.04%	0.00%	-0.02%
过去三个月	0.56%	0.03%	-0.52%	0.07%	1.08%	-0.04%
过去六个月	2.12%	0.06%	-0.21%	0.07%	2.33%	-0.01%
过去一年	6.30%	0.08%	2.74%	0.07%	3.56%	0.01%
过去三年	21.61%	0.15%	5.74%	0.09%	15.87%	0.06%
自基金合同生效起至今	21.64%	0.15%	5.55%	0.10%	16.09%	0.05%

注：①本基金合同于 2013 年 4 月 24 日生效；

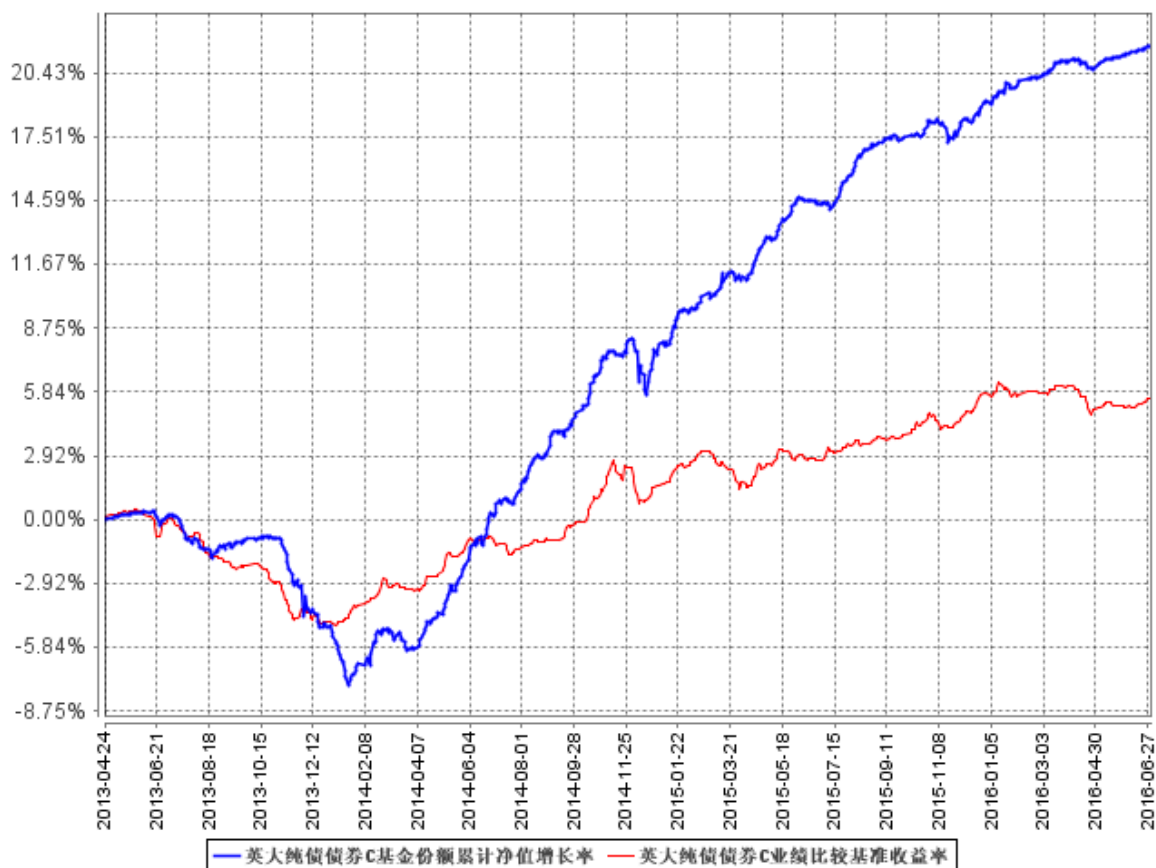
②本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

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

英大纯债债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



英大纯债债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2013 年 4 月 24 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2016 年 6 月 30 日，本公司管理 5 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

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），现任固定收益部总经理。
张玮	本基金基金经理	2016年1月8日	-	5	曾任合众资产管理股份有限公司交易员，2012年10月加入英大基金管理有限公司，曾任公司交易管理部债券交易员、副总经理。

注：①任职日期说明：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。

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，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。

4.3.2 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不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

2016 年从数据来看宏观经济增速略有下降、CPI 稳中有降，债券市场长端品种经历了 4 月份的大幅调整后，震荡下行；同时，2016 年以来信用风险事件频发，成为扰动债券市场的因素之一。

本基金上半年整体保持较低的杠杆水平和账户久期，在资金面扰动的时点增加了对短端品种的配置，既规避了长端品种震荡带来的损失，又较好的把握资金波动带来的收益，全年来看收益可观。

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 类基金累计份额净值为 1.1050 元，报告期基金份额净值增长率为 4.13%；英大纯债 C 类基金累计份额净值为 1.0691 元，报告期基金份额净值增长率为 2.12%；同期业绩比较基准增长率为-0.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，在二季度人民币对美元小幅贬值和经济基本面下行的基础上，随着六月末英国脱欧，人民币汇率进一步贬值，国内经济基本面尚未出现实质性改善，以及国际政治格局的变化，都对国内经济形势产生较大影响。与此同时，产能过剩产业的改革不是一蹴而就的，债转股则是金融行业继续加杠杆，若经济基本面没有实质性改善，将面临更大的金融风险。整个 2016 年三季度，经济和债券市场都存在较大不确定性。

结合我们目前的持仓，展望 2016 年三季度，本基金将保持适度的杠杆水平，深入研究精选信用个券、防范信用风险，在保障流动性的前提下，继续保持稳健的风格，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金实施了利润分配，英大纯债债券 A 于 2016 年 1 月 29 日每 10 份基金份额分红 1.45 元，现金形式发放总额为 72,966,664.35 元，再投资形式发放总额为 102,804.24 元，本期利润分配合计为 73,069,468.59 元；英大纯债债券 C 于 2016 年 1 月 29 日每 10 份基金份额分红 1.45 元，现金形式发放总额为 2,131,057.01 元，再投资形式发放总额为 220,566.50 元，本期利润分配合计为 2,351,623.51 元，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，本基金实施利润分配的金额为 75421092.10 元。其中，A 类为 73069468.59 元，C 类为 2351623.51 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,931,936.03	704,131.86
结算备付金		385,292.66	424,489.27
存出保证金		2,596.11	3,578.61
交易性金融资产	6.4.7.2	272,180,345.59	43,572,790.50
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		272,180,345.59	43,572,790.50
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	31,000,286.50	-
应收证券清算款		300,074.90	58,812.86
应收利息	6.4.7.5	4,231,045.77	1,329,003.99
应收股利		-	-
应收申购款		1,020,518.45	160,996.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		313,052,096.01	46,253,803.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		59,169,871.00	25,226,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		971,778.51	75,657.09
应付管理人报酬		128,913.70	13,255.92
应付托管费		36,832.50	3,787.36
应付销售服务费		25,241.50	3,511.17
应付交易费用	6.4.7.7	6,950.92	844.70
应交税费		-	-
应付利息		27,591.74	37,527.30

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	140,349.05	101,053.11
负债合计		60,507,528.92	25,461,636.65
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	231,357,966.76	17,345,002.31
未分配利润	6.4.7.10	21,186,600.33	3,447,164.13
所有者权益合计		252,544,567.09	20,792,166.44
负债和所有者权益总计		313,052,096.01	46,253,803.09

注：①报告截止日 2016 年 6 月 30 日，英大纯债债券 A 基金份额净值 1.1050 元，基金份额总额 144,830,933.32 份；英大纯债债券 C 基金份额净值 1.0691 元，基金份额总额 86,527,033.44 份。英大纯债债券基金份额总额合计为 231,357,966.76 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		3,270,228.56	3,953,489.87
1.利息收入		3,800,379.40	2,471,803.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	58,069.25	11,032.26
债券利息收入		3,528,300.17	2,445,358.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		214,009.98	15,413.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-334,274.64	2,209,506.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-334,274.64	2,209,506.88
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-354,249.19	-743,854.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	158,372.99	16,033.38
减：二、费用		1,045,104.53	826,593.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	435,453.28	184,978.36

2. 托管费	6.4.10.2.2	124,415.23	52,850.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	62,642.15	80,720.07
4. 交易费用	6.4.7.19	6,277.02	1,277.44
5. 利息支出		346,465.48	398,372.70
其中：卖出回购金融资产支出		346,465.48	398,372.70
6. 其他费用	6.4.7.20	69,851.37	108,393.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,225,124.03	3,126,896.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,225,124.03	3,126,896.80

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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6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）	17,345,002.31	3,447,164.13	20,792,166.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,225,124.03	2,225,124.03
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）	214,012,964.45	90,935,404.27	304,948,368.72
其中：1.基金申购款	826,828,912.78	134,308,429.57	961,137,342.35
2.基金赎回款	-612,815,948.33	-43,373,025.30	-656,188,973.63
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）	-	-75,421,092.10	-75,421,092.10
五、期末所有者权益（基金净值）	231,357,966.76	21,186,600.33	252,544,567.09
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6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

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。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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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

本基金本报告期无会计估计变更。

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

(1) 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

(2) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2016年6月30日
活期存款	3,931,936.03
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,931,936.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016年6月30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	84,797,183.36	84,855,945.59	58,762.23
	银行间市场	187,111,174.93	187,324,400.00	213,225.07
	合计	271,908,358.29	272,180,345.59	271,987.30
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	271,908,358.29	272,180,345.59	271,987.30	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	31,000,286.50	-
合计	31,000,286.50	-

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（2016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 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,597.62
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	173.30
应收债券利息	4,179,881.42
应收买入返售证券利息	35,861.32
应收申购款利息	12,530.91
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.20
合计	4,231,045.77

6.4.7.6 其他资产

无

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6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	6,950.92
合计	6,950.92

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	563.03
预提费用	139,786.02
合计	140,349.05

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

英大纯债债券 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,207,139.27	9,207,139.27
本期申购	709,621,951.50	709,621,951.50
本期赎回(以“-”号填列)	-573,998,157.45	-573,998,157.45
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	144,830,933.32	144,830,933.32

金额单位：人民币元

英大纯债债券 C		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,137,863.04	8,137,863.04
本期申购	117,206,961.28	117,206,961.28
本期赎回(以“-”号填列)	-38,817,790.88	-38,817,790.88
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	86,527,033.44	86,527,033.44

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

英大纯债债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,433,883.52	457,491.27	1,891,374.79

本期利润	1,957,796.52	-305,746.99	1,652,049.53
本期基金份额交易产生的变动数	79,074,301.18	5,662,530.34	84,736,831.52
其中：基金申购款	94,323,467.76	31,284,808.85	125,608,276.61
基金赎回款	-15,249,166.58	-25,622,278.51	-40,871,445.09
本期已分配利润	-73,069,468.59	-	-73,069,468.59
本期末	9,396,512.63	5,814,274.62	15,210,787.25

单位：人民币元

英大纯债债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,153,210.11	402,579.23	1,555,789.34
本期利润	621,576.70	-48,502.20	573,074.50
本期基金份额交易产生的变动数	3,073,053.29	3,125,519.46	6,198,572.75
其中：基金申购款	3,979,155.92	4,720,997.04	8,700,152.96
基金赎回款	-906,102.63	-1,595,477.58	-2,501,580.21
本期已分配利润	-2,351,623.51	-	-2,351,623.51
本期末	2,496,216.59	3,479,596.49	5,975,813.08

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	42,586.04
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	3,341.90
其他	12,141.31
合计	58,069.25

注：存款利息收入项目中，其他包含直销申购款利息收入 12,115.00 元和结算保证金利息收入 26.31 元。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30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	-334,274.64
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	-334,274.64

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	212,855,729.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	207,606,248.59
减：应收利息总额	5,583,755.60
买卖债券差价收入	-334,274.64

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无贵金属投资收益赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无贵金属投资收益申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无衍生工具收益其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-354,249.19
——股票投资	-
——债券投资	-354,249.19
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-354,249.19

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	158,372.99
合计	158,372.99

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	612.02
银行间市场交易费用	5,665.00
合计	6,277.02

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	8,950.76
银行费用	12,865.35
数据证书费（乙类帐户）	200.00
乙类帐户维护费	18,000.00
合计	69,851.37

6.4.7.21 分部报告

无。

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 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	435,453.28	184,978.36
其中：支付销售机构的客户维护费	124,863.85	30,698.97

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

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	124,415.23	52,850.97

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 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	-	31,238.71	31,238.71
中国建设银行股份有限公司	-	12,607.15	12,607.15
合计	-	43,845.86	43,845.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 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	-	74,561.95	74,561.95

注：①C 类基金份额的销售服务费费率为 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6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	3,931,936.03	42,586.04	442,749.41	6,359.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本期末本基金无其他关联交易事项。

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

英大纯债债券 A

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016年1月29日	2016年1月29日	2016年1月29日	1.4500	72,966,664.35	102,804.24	73,069,468.59	
合计	-	-		1.4500	72,966,664.35	102,804.24	73,069,468.59	

英大纯债债券 C

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016年1月29日	2016年1月29日	2016年1月29日	1.4500	2,131,057.01	220,566.50	2,351,623.51	
合计	-	-		1.4500	2,131,057.01	220,566.50	2,351,623.51	

6.4.12 期末（2016年6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（2016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等流通受限股票

本基金本报告期末（2016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 2016 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 5,999,871.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011699215	16 沪华信 SCP001	2016 年 7 月 4 日	100.12	60,000	6,007,200.00
合计				60,000	6,007,200.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 53,170,000.00 元，分别于 2016 年 7 月 1 日—9 月 6 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。

6.4.13.2.1 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	52,122,800.00	5,070,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	79,188,600.00	-
合计	131,311,400.00	5,070,000.00

注：表中列示的未评级债券为超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	7,621,218.60	3,193,000.00
AAA 以下	54,130,166.59	28,696,870.50
未评级	85,738,000.00	6,612,920.00
合计	147,489,385.19	38,502,790.50

注：表中列示的未评级债券为国家债券、央行票据及国家政策性金融债。

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。

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 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,931,936.03	-	-	-	-	-	3,931,936.03
结算备付金	385,292.66	-	-	-	-	-	385,292.66
存出保证金	2,596.11	-	-	-	-	-	2,596.11
交易性金融资产	19,981,000.00	75,406,687.90	101,127,729.60	55,700,928.09	19,964,000.00	-	272,180,345.59
买入返售金融资产	31,000,000.00	-	-	-	-	286.50	31,000,286.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	300,074.90	300,074.90
应收利息	-	-	-	-	-	4,231,045.77	4,231,045.77
应收申购款	-	-	-	-	-	1,020,518.45	1,020,518.45
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	55,300,824.80	75,406,687.90	101,127,729.60	55,700,928.09	19,964,000.00	5,551,925.62	313,052,096.01
负债							
卖出回购金融资产款	59,169,871.00	-	-	-	-	-	59,169,871.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	971,778.51	971,778.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	128,913.70	128,913.70
应付托管费	-	-	-	-	-	36,832.50	36,832.50

应付销售服务费	-	-	-	-	-	25,241.50	25,241.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,950.92	6,950.92
应付利息	-	-	-	-	-	27,591.74	27,591.74
其他负债	-	-	-	-	-	140,349.05	140,349.05
负债总计	59,169,871.00	-	-	-	-	1,337,657.92	60,507,528.92
利率敏感度缺口	-3,869,046.20	75,406,687.90	101,127,729.60	55,700,928.09	19,964,000.00	4,214,267.70	252,544,567.09
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	704,131.86	-	-	-	-	-	704,131.86
结算备付金	424,489.27	-	-	-	-	-	424,489.27
存出保证金	3,578.61	-	-	-	-	-	3,578.61
交易性金融资产	-	5,366,670.00	5,601,768.50	27,296,602.00	5,307,750.00	-	43,572,790.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	58,812.86	58,812.86
应收利息	-	-	-	-	-	1,329,003.99	1,329,003.99
应收申购款	-	-	-	-	-	160,996.00	160,996.00
资产总计	1,132,199.74	5,366,670.00	5,601,768.50	27,296,602.00	5,307,750.00	1,548,812.85	46,253,803.09
负债							
卖出回购金融资产款	25,226,000.00	-	-	-	-	-	25,226,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	75,657.09	75,657.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	13,255.92	13,255.92
应付托管费	-	-	-	-	-	3,787.36	3,787.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,511.17	3,511.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	844.70	844.70
应付利息	-	-	-	-	-	37,527.30	37,527.30
其他负债	-	-	-	-	-	101,053.11	101,053.11
负债总计	25,226,000.00	-	-	-	-	235,636.65	25,461,636.65
利率敏感度缺口	-24,093,800.26	5,366,670.00	5,601,768.50	27,296,602.00	5,307,750.00	1,313,176.20	20,792,166.44

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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	利率下降25个基点	993,851.77	302,813.12
	利率上升25个基点	-989,736.03	-299,044.05

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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	272,180,345.59	107.78	43,572,790.50	209.56
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	272,180,345.59	107.78	43,572,790.50	209.56

6.4.13.4.3.2 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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准的公允价值上升5%	4,499,184.91	446,733.70
业绩比较基准的公允价值下降5%	-4,499,184.91	-446,733.70	

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	272,180,345.59	86.94
	其中：债券	272,180,345.59	86.94
	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	31,000,286.50	9.90
	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	4,317,228.69	1.38
7	其他各项资产	5,554,235.23	1.77
8	合计	313,052,096.01	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末（2016年6月30日），本基金未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末（2016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所有股票投资明细

报告期末（2016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（2016年1月1日至2016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（2016 年 1 月 1 日至 2016 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（2016 年 1 月 1 日至 2016 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	45,759,000.00	18.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,979,000.00	15.83
	其中：政策性金融债	39,979,000.00	15.83
4	企业债券	46,706,945.59	18.49
5	企业短期融资券	131,311,400.00	52.00
6	中期票据	6,075,000.00	2.41
7	可转债（可交换债）	2,349,000.00	0.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	272,180,345.59	107.78

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	011699113	16 新兴际华 SCP001	200,000	20,034,000.00	7.93
2	011599972	15 鲁焦化 SCP002	190,000	19,112,100.00	7.57
3	011699820	16 皖山鹰 SCP002	150,000	15,007,500.00	5.94
4	112142	12 格林债	120,001	12,634,905.29	5.00
5	041558072	15 仙琚 CP001	100,000	10,075,000.00	3.99

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末（2016 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（2016 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

报告期末（2016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国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

本基金本报告期内未持有股票。

7.11.3 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	2,596.11
2	应收证券清算款	300,074.90
3	应收股利	-
4	应收利息	4,231,045.77
5	应收申购款	1,020,518.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,554,235.23

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末（2016年6月30日），本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未持有股票。

7.11.6 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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
英大纯债债券 A	2,714	53,364.38	55,223,497.81	38.13%	89,607,435.51	61.87%
英大纯债债券 C	361	239,687.07	71,670,934.49	82.83%	14,856,098.95	17.17%
合计	3,075	75,238.36	126,894,432.30	54.85%	104,463,534.46	45.15%

8.2 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	45,024.21	0.0311%
	英大纯债债券 C	-	-
	合计	45,024.21	0.0195%

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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	英大纯债债券 A	0
	英大纯债债券 C	0

有本开放式基金	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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大纯债债券 A	英大纯债债券 C
基金合同生效日（2013 年 4 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	9, 207, 139. 27	8, 137, 863. 04
本报告期基金总申购份额	709, 621, 951. 50	117, 206, 961. 28
减：本报告期基金总赎回份额	573, 998, 157. 45	38, 817, 790. 88
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	144, 830, 933. 32	86, 527, 033. 44

§ 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，基金管理人于 2016 年 3 月 17 日发布公告，宗宽广先生自 2016 年 3 月 16 日起担任英大基金管理有限公司督察长，副总经理赵照先生自 2016 年 3 月 16 日起不再代任督察长职务。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 2016 年 1 月 12 日发布公告，张玮女士自 2016 年 1 月 8 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，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

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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	59,162,289.45	100.00%	448,458,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	英大基金关于旗下基金 2015 年年度最后一个市场交易日资产净值的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 1 日
2	英大基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所指数发生不可恢复熔断的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 4 日
3	英大基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 7 日
4	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	2016 年 1 月 12 日
5	英大纯债债券型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 22 日
6	英大纯债债券型证券投资基金 2016 年第一次收益分配公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 1 月 27 日
7	英大基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 3 月 17 日
8	英大纯债债券型证券投资基金 2015 年年度报告及摘要	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 3 月 30 日
9	英大纯债债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2016 年 4 月 21 日
10	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	2016 年 6 月 7 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

2016年8月25日