

英大纯债债券型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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：2016 年 10 月 26 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 2016 年 10 月 25 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 2016 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	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	463,804,767.22 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	372,360,983.91 份	91,443,783.31 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（2016年7月1日—2016年9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	1,932,592.01	968,067.28
2. 本期利润	2,941,556.12	1,524,306.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0185	0.0172
4. 期末基金资产净值	418,561,421.56	99,338,680.37
5. 期末基金份额净值	1.1241	1.0863

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

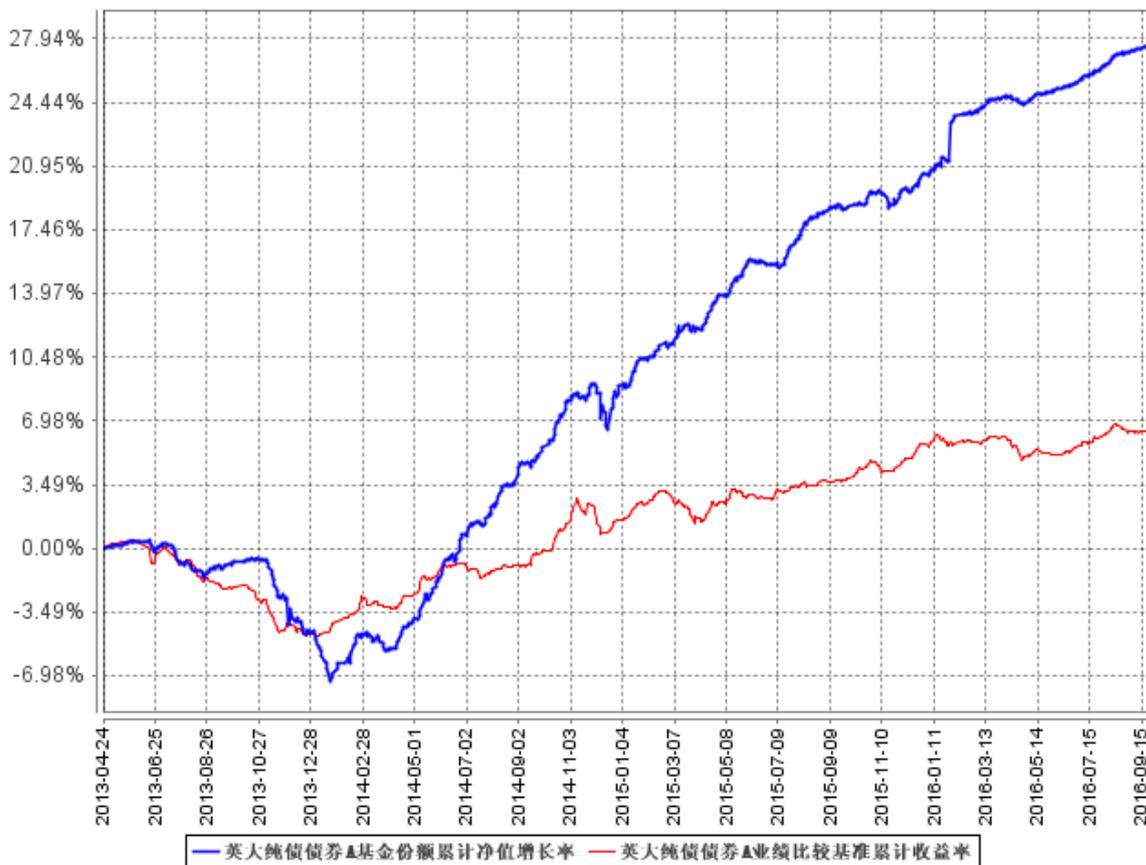
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.73%	0.03%	0.91%	0.05%	0.82%	-0.02%

英大纯债债券 C

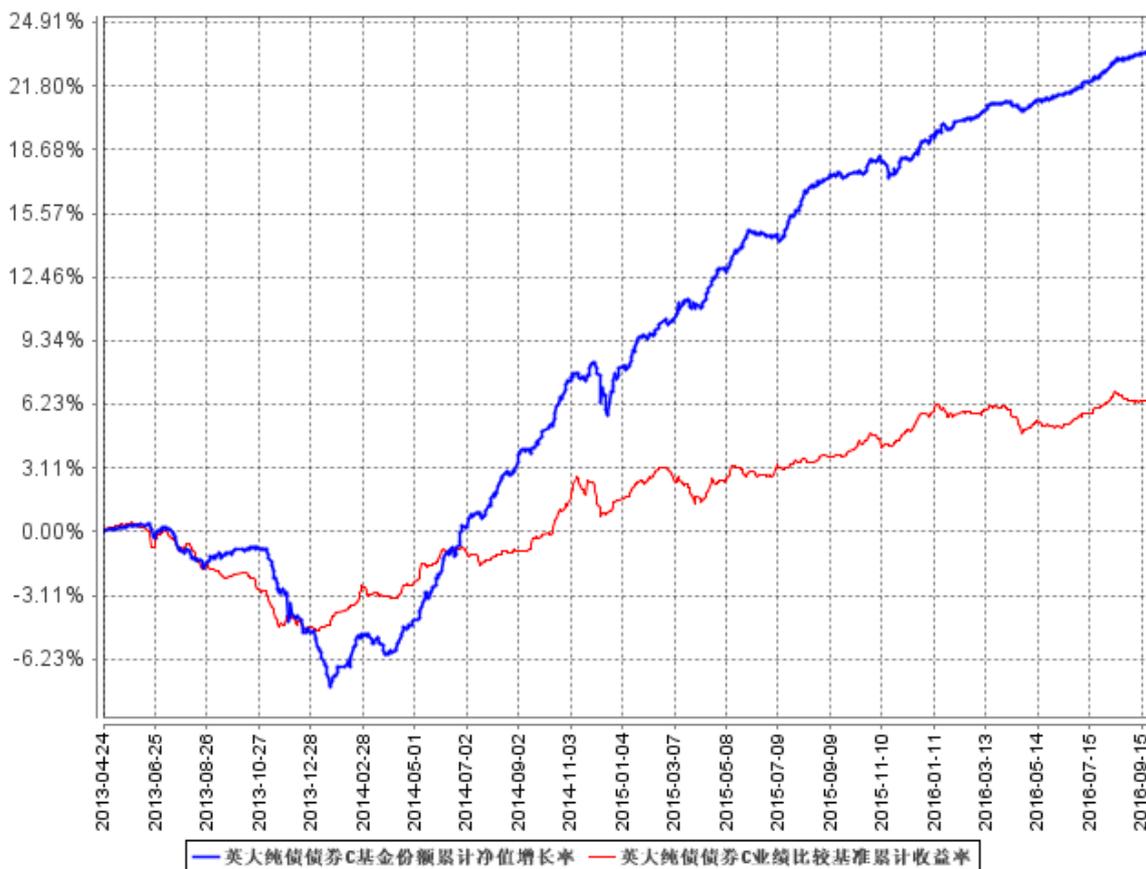
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.61%	0.03%	0.91%	0.05%	0.70%	-0.02%

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

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



§ 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		
张琳娜	本基金经理	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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年三季度从数据来看宏观经济整体运行平稳、债券市场超长端品种收益率大幅下行，利率品种收益率曲线平坦化；同时，前期信用违约事件风波暂时平缓后，中低评级品种整体收益率曲线修复，信用利差收窄。

本基金三季度整体保持较低的杠杆水平和账户久期，在资金扰动的时点增加了对短端品种的配置，积极把握利率品种波段操作，既获得了前期信用利差修复带来的收益，又较好的把握波段操作带来的收益，全年来看收益可观。

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 1.2691 元，报告期基金份额净值增长率为 1.73%；英大纯债 C 类基金累计份额净值为 1.2313 元，报告期基金份额净值增长率为 1.61%；同期业绩比较基准增长率为 0.91%。

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。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	454,739,303.70	84.60
	其中：债券	454,739,303.70	84.60
	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	70,600,585.90	13.13
	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	5,844,374.11	1.09
8	其他资产	6,353,277.61	1.18
9	合计	537,537,541.32	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	49,826,000.00	9.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,187,000.00	11.81
	其中：政策性金融债	61,187,000.00	11.81
4	企业债券	63,380,703.70	12.24
5	企业短期融资券	270,021,600.00	52.14
6	中期票据	10,324,000.00	1.99
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	454,739,303.70	87.80

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	160418	16 农发 18	300,000	31,059,000.00	6.00
2	011698512	16 厦国贸 SCP012	300,000	30,009,000.00	5.79
2	071633004	16 华融证券 CP004	300,000	30,009,000.00	5.79
3	011698495	16 龙源电力 SCP012	300,000	29,994,000.00	5.79
4	011699970	16 国航股 SCP007	250,000	25,037,500.00	4.83
4	011698014	16 中车 SCP002	250,000	25,037,500.00	4.83
5	041654027	16 金红叶 CP001	200,000	20,140,000.00	3.89

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国债期货交易情况说明**5.9.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注**5.10.1**

本期内未发现本基金投资的前十名证券的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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,191.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,250,498.07
5	应收申购款	99,588.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,353,277.61

5.10.4 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。

5.10.5 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

项目	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	144,830,933.32	86,527,033.44
报告期期间基金总申购份额	264,312,090.95	15,171,766.37
减：报告期期间基金总赎回份额	36,782,040.36	10,255,016.50
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	372,360,983.91	91,443,783.31

§ 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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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
2016 年 10 月 26 日