

英大纯债债券型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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：2019年8月26日

1.1 重要提示
基金管理人、董事、监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2019年8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预示其未来表现，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2019年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况	2.2 基金产品说明
基金名称 基金代码 基金运作方式 基金合同生效日 基金管理人 基金托管人 报告期末基金份额总额 基金合同存续期限 下属分级基金的名称简称 下属分级基金的类别 报告期末下属分级基金的份额总额	英大纯债债券 690001 契约型封闭式 2018年6月30日 英大基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司 1,719,128,217.99份 不定期 英大纯债债券A 英大纯债债券C 690002 64,357,174.27份

2.3 基金管理人	基金托管人
名称 住所 办公地址 信息披露负责人 联系电话 客户服务电话 传真	英大基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区宣武门内大街28号 北京市西城区宣武门内大街28号 北京市西城区宣武门内大街28号 北京市西城区宣武门内大街28号 北京市西城区宣武门内大街28号 北京市西城区宣武门内大街28号

2.4 信息披露方式
基金净值查询及公告的网站 基金管理人及基金托管人的办公地址

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	报告期末1月1日至2019年6月30日	报告期末1月1日至2019年6月30日
本期已实现收益	10,888,001.46	889,442.93
本期公允价值变动收益	6,548,004.06	-215,285.36
加权平均基金份额本期收益	0.0098	-0.0016
本基金加权平均基金份额净值增长率	0.0098	0.039
3.1.2 期末数据和指标	报告期末2019年6月30日	报告期末2019年6月30日
期末可供分配基金份额利润	0.0072	0.0040
期末基金份额净值	1.882,51,118.49	71,312,176.06
期末基金份额总额	1,126	1,101

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、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。4、期末可供分配利润采用资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	0.56%	0.06%	0.06%	0.06%	0.03%	0.00%
过去三个月	-0.06%	0.10%	0.10%	0.06%	-0.06%	0.04%
过去六个月	0.54%	0.11%	0.24%	0.06%	0.30%	0.05%
过去一年	6.28%	0.14%	2.82%	0.06%	3.46%	0.08%
过去三年	13.16%	0.09%	0.03%	0.08%	13.13%	0.01%
自基金合同生效至今	42.04%	0.13%	5.58%	0.09%	36.46%	0.04%

过去三个月	-0.06%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.19%	0.04%
过去六个月	0.54%	0.11%	0.24%	0.06%	0.30%	0.05%
过去一年	6.38%	0.14%	2.82%	0.06%	3.56%	0.08%
过去三年	13.16%	0.09%	0.03%	0.08%	13.13%	0.01%
自基金合同生效起	42.04%	0.13%	5.58%	0.09%	36.46%	0.04%

英大纯债债券C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.54%	0.06%	0.28%	0.03%	0.26%	0.03%

过去一个月	-0.14%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.10%	0.04%
过去六个月	0.29%	0.11%	0.24%	0.06%	0.15%	0.05%
过去一年	5.98%	0.14%	2.82%	0.06%	3.16%	0.08%
过去三年	11.80%	0.09%	0.03%	0.08%	11.77%	0.01%
自基金合同生效起	36.00%	0.12%	5.58%	0.09%	30.42%	0.03%

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C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较图						
图例	基金份额累计净值增长率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④	①-④	②-⑤
过去一个月	0.54%	0.06%	0.28%	0.03%	0.26%	0.03%
过去三个月	-0.14%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.19%	0.04%
过去六个月	0.29%	0.11%	0.24%	0.06%	0.16%	0.05%
过去一年	5.08%	0.14%	2.82%	0.06%	3.16%	0.08%
过去三年	11.60%	0.09%	0.03%	0.08%	11.77%	0.01%
自基金合同生效至今	36.00%	0.12%	5.58%	0.09%	30.42%	0.03%

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去一个月	0.54%	0.06%	0.28%	0.03%	0.26%
过去三个月	-0.14%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.19%
过去六个月	0.29%	0.11%	0.24%	0.06%	0.16%
过去一年	5.08%	0.14%	2.82%	0.06%	3.16%
过去三年	11.60%	0.09%	0.03%	0.08%	11.77%
自基金合同生效至今	36.00%	0.12%	5.58%	0.09%	30.42%

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去一个月	0.54%	0.06%	0.28%	0.03%	0.26%
过去三个月	-0.14%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.19%
过去六个月	0.29%	0.11%	0.24%	0.06%	0.16%
过去一年	5.08%	0.14%	2.82%	0.06%	3.16%
过去三年	11.60%	0.09%	0.03%	0.08%	11.77%
自基金合同生效至今	36.00%	0.12%	5.58%	0.09%	30.42%

① 过去一个月：0.54% - 0.28% = 0.26%
 ② 过去三个月：-0.14% - (-0.24%) = 0.10%
 ③ 过去六个月：0.29% - 0.24% = 0.05%
 ④ 过去一年：5.08% - 2.82% = 2.26%
 ⑤ 过去三年：11.60% - 0.03% = 11.57%
 ⑥ 自基金合同生效至今：36.00% - 5.58% = 30.42%

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去一个月	0.54%	0.06%	0.28%	0.03%	0.26%
过去三个月	-0.14%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.19%
过去六个月	0.29%	0.11%	0.24%	0.06%	0.16%
过去一年	5.08%	0.14%	2.82%	0.06%	3.16%
过去三年	11.60%	0.09%	0.03%	0.08%	11.77%
自基金合同生效至今	36.00%	0.12%	5.58%	0.09%	30.42%

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去一个月	0.54%	0.06%	0.28%	0.03%	0.26%
过去三个月	-0.14%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.19%
过去六个月	0.29%	0.11%	0.24%	0.06%	0.16%
过去一年	5.08%	0.14%	2.82%	0.06%	3.16%
过去三年	11.60%	0.09%	0.03%	0.08%	11.77%
自基金合同生效至今	36.00%	0.12%	5.58%	0.09%	30.42%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合指数。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及基金管理基金的经验

英大基金管理有限公司(以下简称“公司”)成立于2012年8月17日,注册资本为20,000万元人民币。现有三家股东,分别是网英大国际控股集团有限公司、交通建设股份有限公司、航天科工财务有限责任公司,持股比例分别为49%和15%。

公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

会参与其他业务。公司90%以上的员工来自基金业协会等金融机构,平均从业时间超过10年,硕士以上学历的员工占员工总数70%以上,核心团队拥有丰富行业经验并具备行业影响力。

公司自成立以来秉承了闽有企业诚信、责任、奉献的优良传统,确立了以“诚信、专业、创新”为核心的企业文化,坚持以维护基金持有人利益为经营原则,坚

坚持“公私协同反联、两翼齐飞的战略，坚持以市场化为导向，坚持价值投资、长期经营理念，注重发展和创新，建立了科学、专业的投资体系和严谨的风控体系，力争享有核心竞争力、受人尊敬、业内领先的专研财富管理公司。

截至2019年6月30日，本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先巨混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英国国企改革主题股票基金。

投资于基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金及基金基金、英大睿盛混合型证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、英大睿盛混合型证券投资基金、英大睿鑫						
---	--	--	--	--	--	--

易旗坤	本基金基金经理	2017年12月28日	-	8	北京大学理学学士,8年以上证券从业经历。2011年8月至2013年8月就职于寶富投資咨詢(上海)有限公司,任衍生品交易员。2013年10月加入英大基金管理有限公司,历任交易员、基金经理。2015年12月受聘为英大资管集团总经理(主持工
-----	---------	-------------	---	---	---

					金经理、英大现金宝货币基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

4.2. 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

《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。

4.3.1 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、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。

英大纯债债券C						
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④	
过去一个月	0.54%	0.06%	0.28%	0.03%	0.26%	0.03%
过去三个月	-0.14%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.19%	0.04%
过去六个月	0.29%	0.11%	0.24%	0.06%	0.16%	0.05%
过去一年	5.08%	0.14%	2.82%	0.06%	3.16%	0.08%
过去三年	11.60%	0.09%	0.03%	0.08%	11.77%	0.01%
自基金合同生效至今	36.00%	0.12%	5.58%	0.09%	30.42%	0.03%

英大纯债债券C						
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④	
过去一个月	0.54%	0.06%	0.28%	0.03%	0.26%	0.03%
过去三个月	-0.14%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.19%	0.04%
过去六个月	0.29%	0.11%	0.24%	0.06%	0.16%	0.05%
过去一年	5.08%	0.14%	2.82%	0.06%	3.16%	0.08%
过去三年	11.60%	0.09%	0.03%	0.08%	11.77%	0.01%
自基金合同生效至今	36.00%	0.12%	5.58%	0.09%	30.42%	0.03%

英大纯债债券C						
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④	
过去一个月	0.54%	0.06%	0.28%	0.03%	0.26%	0.03%
过去三个月	-0.14%	0.10%	-0.24			