英大纯债债券型证券投资基金

【2015】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:2016年3月30日

§1 重要提示

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3月25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。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	17,345,002.31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	9,207,139.27份	8,137,863.04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	赵照	田青
	联系电话	010-59112177	010-67595096
	电子邮箱	zhaozhao@ydamc.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-890-5288	010-67595096
传真		010-85878087	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ydamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年		2014年		2013年4月24日(基金合同生效日)-2013年12月31日	
	英大纯债债券A	英大纯债债券C	英大纯债债券A	英大纯债债券C	英大纯债债券A	英大纯债债券C
本期已实现收益	1,355,954.14	3,864,453.73	-6,810,002.53	2,639,352.43	-1,476,837.94	1,422,262.89
本期利润	1,194,057.82	3,443,645.41	14,659,162.65	8,351,806.88	-20,125,895.69	-5,901,357.96
加权平均基金份额本期利润	0.1139	0.1051	0.0997	0.1235	-0.0357	-0.0222
本期基金份额净值增长率	10.73%	10.27%	14.01%	13.49%	-4.52%	-4.81%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
期末可供分配基金份额利润	0.1557	0.1417	0.0274	0.0194	-0.0452	-0.0481
期末基金资产净值	11,098,514.06	9,693,652.38	16,870,150.71	54,340,205.81	291,471,865.72	80,499,151.72
期末基金份额净值	1.2054	1.1912	1.0896	1.0803	0.9548	0.9519

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
过去三个月	1.50%	0.11%	1.81%	0.08%	-0.31%	0.03%
过去六个月	4.32%	0.09%	2.95%	0.07%	1.37%	0.02%
过去一年	10.73%	0.10%	4.19%	0.08%	6.54%	0.02%
自基金合同生效起至今	20.54%	0.16%	5.77%	0.10%	14.77%	0.06%

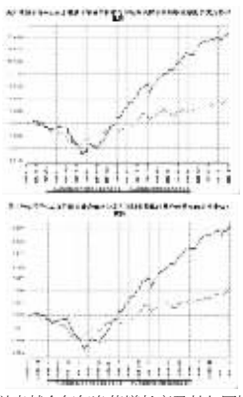
英大纯债债券C

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
过去三个月	1.40%	0.11%	1.81%	0.08%	-0.41%	0.03%
过去六个月	4.10%	0.09%	2.95%	0.07%	1.15%	0.02%
过去一年	10.27%	0.10%	4.19%	0.08%	6.08%	0.02%
自基金合同生效起至今	19.12%	0.16%	5.77%	0.10%	13.35%	0.06%

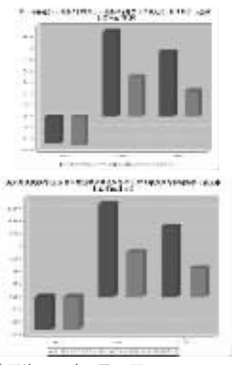
注:①本基金合同于2013年4月24日生效;

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同生效日为2013年4月24日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年未进行利润分配。

§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12月31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 公平交易制度和控制方法

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等国家法律法规和监管部门的规定,公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》,适用于公司所管理的全部公募基金、特定客户资产管理组合、社保基金、企业年金等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括公司的投资决策实行投资决策委员会领导下的基金经理/投资经理负责制,明确各自的投资权限,保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性,交易执行部门与投资决策部门严格分离,业绩与风险评估以数量分析为基础,对投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程,明确投资各环节的业务职责,防范投资风险。公司的所有投资组合共享公司统一的投资研究平台,投资研究团队使用同一研究报告系统,确保公募基金、特定客户资产管理组合等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括公司建立交易分配公平的内部控制流程,将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行包括所有投资品种的集中交易制度,并确保公平交易可操作、可稽核、可持续。公司在交易系统中设置公平交易功能并严格执行,以技术措施保障公平交易的实现。

监察稽核部定期对公司的不同投资组合(尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合)在连续四个季度期间内、不同时间窗下(1日内、3日内、5日内等)的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

4.3.2 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。

4.3.3 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年债市收益率震荡下行,十年国债年末比年初下行81BP,资金价格更是一路走低,全年来看,2015年债券牛市行情上半年资金牛,下半年长端牛。美联储于2015年12月正式步入加息通道,人民币贬值加速,因年末IPO重启,资金价格稍有走高,但幅度较小。

本基金全年来看配置转换较好,同时享受了上半年资金价格走低和下半年长端利率债大幅下行的收益。

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1.2054元,报告期基金份额净值增长率为10.73%;英大纯债C类基金份额净值为1.1912元,报告期基金份额净值增长率为10.27%;同期业绩比较基准增长率4.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2016年,人民币汇率和信用风险成为影响债券市场最重要的两个因素。2016年财政部公布的国债发行计划较2014年、2015年有明显增加,这与提高财政赤字思路一致,财政政策的发力效果时效性更为明显。十三五开局之年不可忽视政策层面对经济的支撑力度。供给侧改革、清理僵尸企业不是一蹴而就的,其过程曲折,并受政策影响较大,从投资层面来讲,较难把握。同时央行对待汇率的态度有所转变,公开市场操作更加灵活且频繁。

因此,2016年,本基金将保持中性的杠杆水平,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。

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

过去三年本基金未进行利润分配,本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

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

自2015年11月11日起至2015年12月31日,本基金出现连续二十个工作日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损害基金份额持有人利息的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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 审计报告

本基金2015年年度财务会计报告经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了瑞华审字[2016]01390221号"标准无保留意见的审计报告",投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1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12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		704,131.86	8,080,850.57
结算备付金		424,489.27	614,562.43
存出保证金		3,578.61	16,962.47
交易性金融资产		43,572,790.50	100,197,878.43
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		43,572,790.50	100,197,878.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		58,812.86	1,999,994.90
应收利息		1,329,003.99	2,960,883.58
应收股利		-	-
应收申购款		160,996.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		46,253,803.09	113,871,132.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31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		25,226,000.00	42,063,945.70
应付证券清算款		-	7,546.87
应付赎回款		75,657.09	316,520.48
应付管理人报酬		13,256.92	49,634.53
应付托管费		3,787.36	14,181.26
应付销售服务费		3,511.17	20,735.18
应付交易费用		844.70	465.00
应交税费		-	-
应付利息		37,527.30	27,592.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		101,053.11	160,154.23
负债合计		25,461,636.65	42,660,775.86
所有者权益:			
实收基金		17,345,002.31	65,797,343.16
未分配利润		3,447,164.13	5,413,013.36
所有者权益合计		20,792,166.44	71,210,356.52
负债和所有者权益总计		46,253,803.09	113,871,132.38

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额总额17,345,002.31份。其中A类基金份额净值1.2054元,基金份额总额9,207,139.27份;B类基金份额净值1.1912元,基金份额总额8,137,863.04份。

7.2 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1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		6,079,370.96	29,591,068.31
1.利息收入		4,203,320.54	19,104,566.86
其中:存款利息收入		19,149.51	107,949.86
债券利息收入		4,166,175.75	18,964,249.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,995.28	32,367.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,439,170.18	-16,751,691.71
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,439,170.18	-16,751,691.71
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-582,704.64	27,181,619.63
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		19,584.88	56,573.53
减:二、费用		1,441,667.73	6,580,098.78
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	351,134.11	1,496,555.14
2. 托管费	7.4.8.2.2	100,323.91	424,730.01
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	151,783.17	271,844.58
4. 交易费用		2,090.52	12,351.97
5. 利息支出		615,390.02	4,217,286.24
其中:卖出回购金融资产支出		615,390.02	4,217,286.24
6. 其他费用		220,946.00	167,330.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		4,637,703.23	23,010,969.53
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		4,637,703.23	23,010,969.53

7.3 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1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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(本期净利润)	-	4,637,703.23	4,637,703.23
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)	-48,452,340.85	-6,603,552.46	-55,055,893.31
其中:1.基金申购款	72,986,406.24	10,887,032.86	83,873,439.10
2.基金赎回款	-121,438,747.09	-17,490,585.32	-138,929,332.41
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)	17,345,002.31	3,447,164.13	20,792,166.44
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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(本期净利润)	-	23,010,969.53	23,010,969.53
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)	-324,035,154.44	263,523.99	-323,771,630.45
其中:1.基金申购款	138,118,621.82	2,678,663.71	140,797,285.53
2.基金赎回款	-462,153,776.26	-2,415,139.72	-464,568,915.98
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)	65,797,343.16	5,413,013.36	71,210,356.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市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),按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的会计差错更正。

7.4.3 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、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。

7.4.4 关联方关系

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。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.5.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.5.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.5.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.5.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间,本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	351,134.11	1,496,555.14
其中:支付销售机构的客户维护费	75,384.84	429,026.37

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。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	100,323.91	424,730.01

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。

7.4.5.2.3 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1月1日至2015年12月31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	-	101,373.22	101,373.22
中国建设银行股份有限公司	-	20,409.10	20,409.10
合计	-	121,782.32	121,782.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	-	108,911.01	108,911.01
中国建设银行股份有限公司	-	150,198.18	150,198.18
合计	-	259,109.19	259,109.19

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。

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告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。

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 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。

7.4.5.4.2 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

本基金本报告期末其他关联方未持有本基金。

7.4.5.5 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1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	704,131.86	12,396.34	8,080,850.57	41,383.83

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.5.6 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。

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间,本基金未在无其他关联交易事项的说明。

7.4.6 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末(2015年12月31日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通的证券。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末(2015年12月31日)未持有需披露的暂时停牌股票。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31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0.00元。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31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25,226,000.00元,分别于2016年1月5日——3月4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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

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	43,572,790.50	94.20
	其中:债券	43,572,790.50	94.20
	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	1,128,621.13	2.44
7	其他各项资产	1,552,391.46	3.36
8	合计	46,253,803.09	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

报告期末(2015年12月31日),本基金未持有股票。

8.3 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

报告期内(2015年1月1日至2015年12月31日),本基金未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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12月31日),本基金未持有股票。

8.4.2 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12月31日),本基金未持有股票。

8.4.3 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12月31日),本基金未持有股票。

8.5 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	6,612,920.00	31.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	31,889,870.50	153.37
5	企业短期融资券	5,070,000.00	24.38
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,572,790.50	209.56

8.6 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	041554013	15三鼎CP001	50,000	5,070,000.00	24.38
2	122125	11美兰债	46,000	5,053,560.00	24.31
3	122132	12鹏博债	40,000	4,175,200.00	20.08
4	112089	12明牌债	40,000	4,113,200.00	19.78
5	122678	12扬化工	37,000	3,994,890.00	19.21

8.7 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

本报告期末(2015年12月31日),本基金未持有资产支持证券。

8.8 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

报告期内(2015年12月31日),本基金未持贵金属。

8.9 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(2015年12月31日),本基金未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1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。

8.10.2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。

8.10.3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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

本基金本报告期内未持有股票。

8.11.3 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	3,578.61
2	应收证券清算款	58,812.86
3	应收股利	-
4	应收利息	1,329,003.99
5	应收申购款	160,996.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,552,391.46

8.11.4 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。

8.11.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	193	47,706.38	0.00	0.00%	9,207,139.27	100.00%
英大纯债债券C	193	42,165.09	0.00	0.00%	8,137,863.04	100.00%
合计	386	44,935.24	0.00	0.00%	17,345,002.31	100.00%

9.2 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	419.94	0.0046%
	英大纯债债券C	-	-
	合计	419.94	0.0024%

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