

英大纯债债券型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 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：2020 年 3 月 31 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 2020 年 3 月 27 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 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	14
§ 4 管理人报告	16
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.9 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.....	20
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
§ 6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§ 7 年度财务报表	25
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 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.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54

8.7 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	54
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	54
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	54
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.11 投资组合报告附注	55
§ 9 基金份额持有人信息.....	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.3 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	56
§ 10 开放式基金份额变动.....	57
§ 11 重大事件揭示.....	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
11.2 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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	60
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 13 备查文件目录.....	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	65

§ 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	
场内简称	-	
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	3,846,150,826.96 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
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
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	650001	650002
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	3,815,231,767.92 份	30,919,059.04 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。主要投资策略包括久期策略、期限结构策略、类属资产配置策略、辅助策略。	
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，其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。	
	英大纯债债券 A	英大纯债债券 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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	刘康喜	田青

	联系电话	010-59112026	010-67595096
	电子邮箱	liukx@ydamc.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-890-5288	010-67595096
传真		010-59112222	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2201	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100020	100033
法定代表人		马晓燕	田国立

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办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
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、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	2019 年		2018 年		2017 年	
	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	55,428,163.69	1,735,664.12	9,175,760.45	1,087,387.33	7,607,378.39	263,986.16
本期利润	66,531,441.51	885,349.78	18,632,274.23	2,386,443.38	5,768,942.46	183,548.69
加权平均基金份额本期利润	0.0436	0.0097	0.0869	0.0775	0.0254	0.0236
本期加权平均	3.84%	0.88%	7.79%	7.11%	2.23%	2.14%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	2.88%	2.55%	8.09%	7.63%	2.36%	1.94%
3.1. 2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期末可供分配利润	295,120,844.43	1,795,562.05	13,036,112.26	3,215,525.74	26,856,511.59	226,050.78
期末可供分配基金份额利润	0.0774	0.0581	0.0454	0.0301	0.1196	0.0747

期末基金资产净值	4,393,545,575.97	35,001,302.73	321,336,573.34	117,799,815.46	258,457,442.47	3,346,317.09
期末基金份额净值	1.1516	1.1320	1.1194	1.1038	1.1506	1.1062
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	45.33%	38.93%	41.27%	35.47%	30.70%	25.87%

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中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

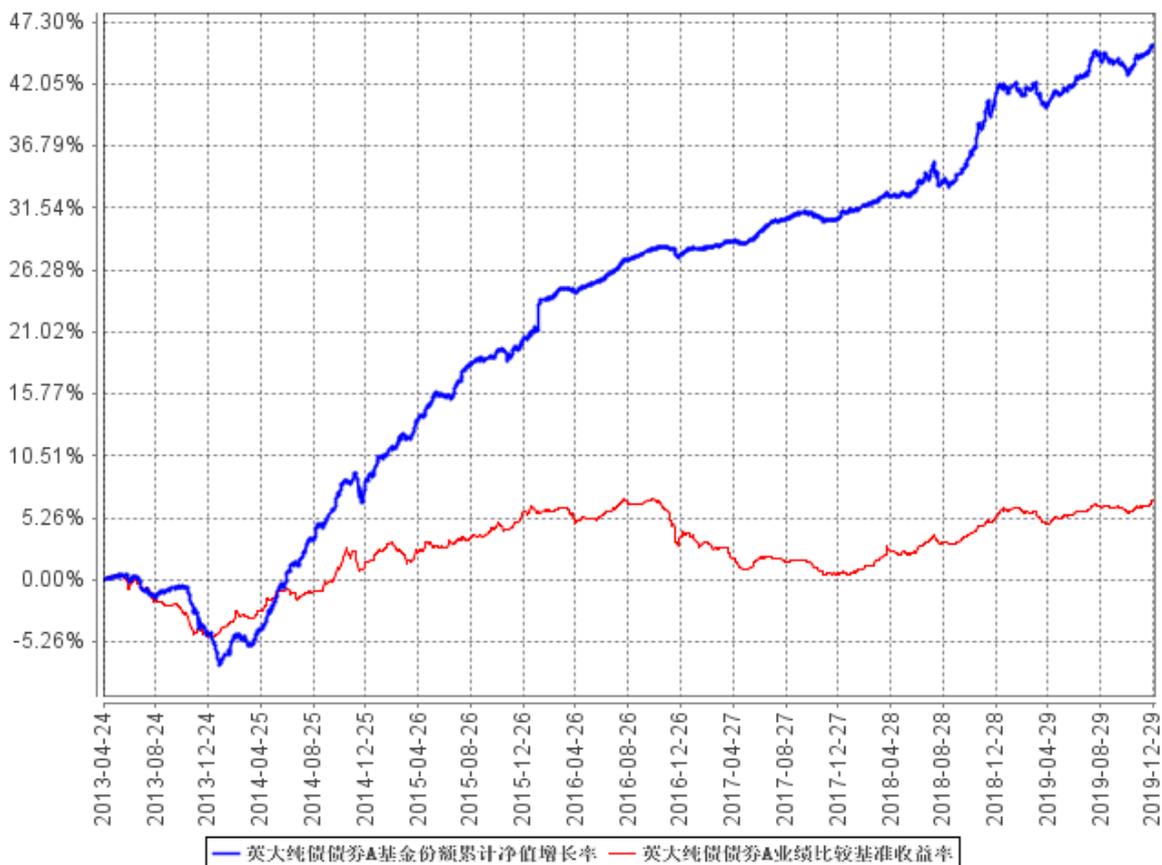
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.04%	0.09%	0.61%	0.04%	0.43%	0.05%
过去六个月	2.32%	0.10%	1.07%	0.04%	1.25%	0.06%
过去一年	2.88%	0.11%	1.31%	0.05%	1.57%	0.06%
过去三年	13.82%	0.10%	2.57%	0.06%	11.25%	0.04%
过去五年	33.51%	0.10%	5.12%	0.07%	28.39%	0.03%
自基金合同生效起至今	45.33%	0.13%	6.71%	0.08%	38.62%	0.05%

英大纯债债券 C

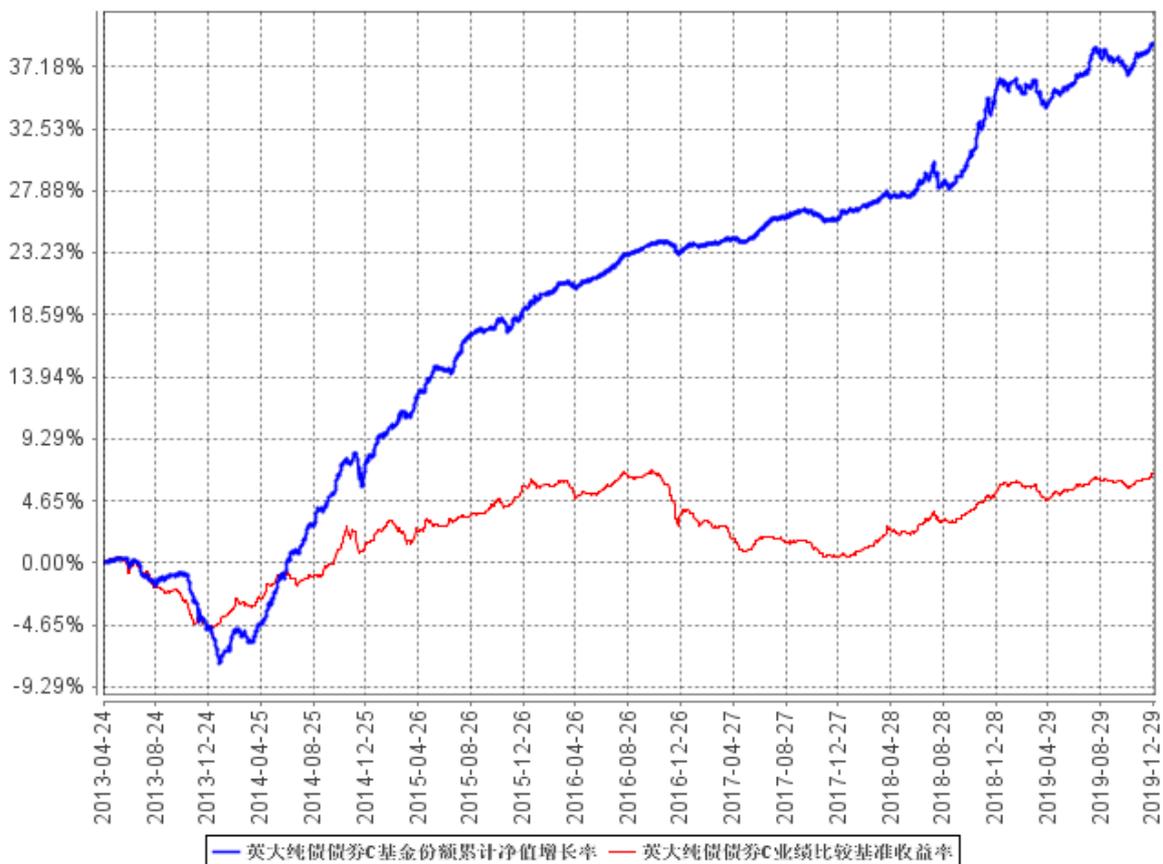
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.95%	0.09%	0.61%	0.04%	0.34%	0.05%
过去六个月	2.16%	0.10%	1.07%	0.04%	1.09%	0.06%
过去一年	2.55%	0.11%	1.31%	0.05%	1.24%	0.06%
过去三年	12.53%	0.10%	2.57%	0.06%	9.96%	0.04%
过去五年	28.61%	0.09%	5.12%	0.07%	23.49%	0.02%
自基金合同生效起至今	38.93%	0.12%	6.71%	0.08%	32.22%	0.04%

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

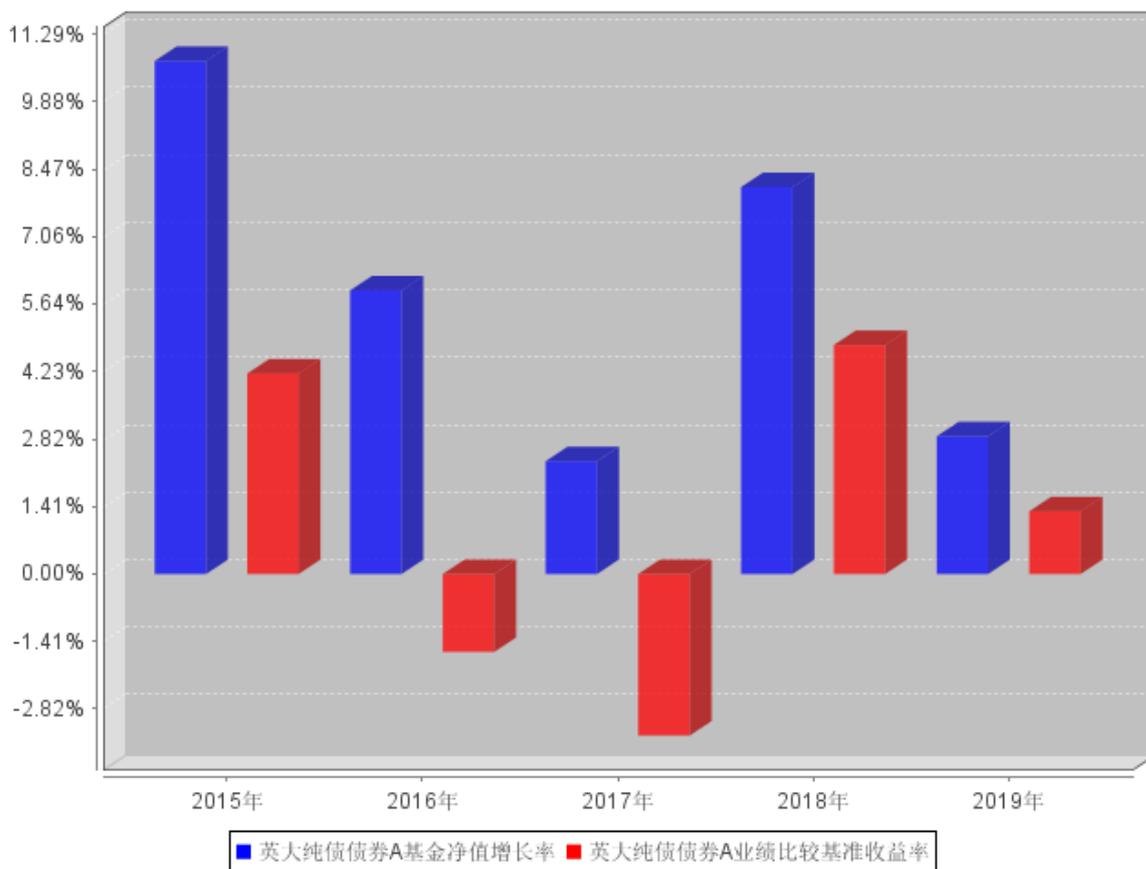


英大纯债债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

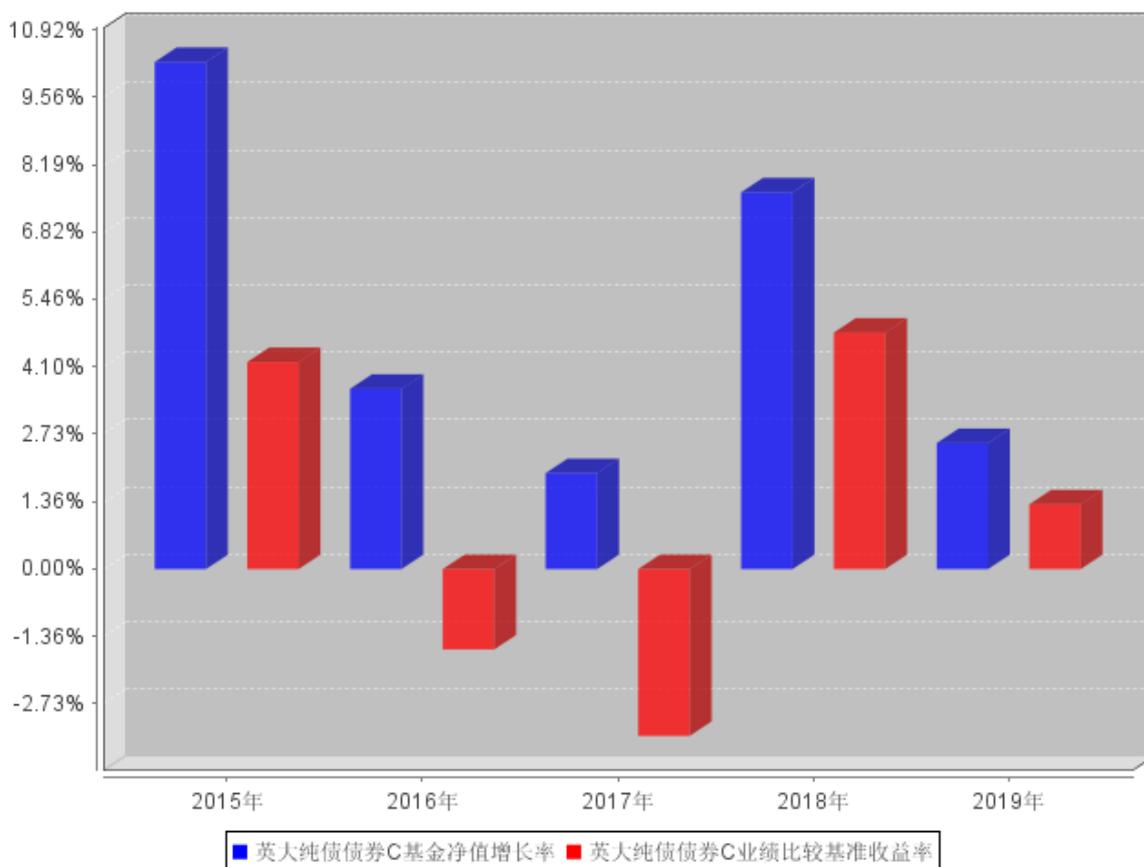


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大纯债债券A过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



英大纯债债券C过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

英大纯债债券 A					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2019	-	-	-	-	
2018	1.1700	22,197,439.84	2,437,325.87	24,634,765.71	
2017	-	-	-	-	
合计	1.1700	22,197,439.84	2,437,325.87	24,634,765.71	

单位：人民币元

英大纯债债券 C					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2019	-	-	-	-	
2018	0.8200	7,430,509.32	46,507.50	7,477,016.82	

2017	-	-	-	-	
合计	0.8200	7,430,509.32	46,507.50	7,477,016.82	

§ 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

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 31,600 万元人民币。现有三家股东，分别是国网英大国际控股集团有限公司、中国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 67.7%、22.8%和 9.5%。

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。公司员工平均行业从业时间超过 10 年，硕士以上学历的员工占员工总数 70%以上，核心团队拥有丰富的经验和行业影响力。

公司自成立就秉承了国有企业诚信、责任、奉献的优良传统，确立了以“梦想、真诚、专业、稳健”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，坚持公募、专户协同发展、两翼齐飞的战略，坚持以市场为导向，坚持价值投资、长期投资理念，注重发展和创新，建立了科学、专业的投研体系和严谨的风控体系，力争成为具有核心竞争力、受人尊敬、业内领先的专业财富管理公司。

截至 2019 年 12 月 31 日，本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大策略优选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、英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金 9 只开放式证券投资基金，同时，管理过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		
易祺坤	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 月就职于寰富投资咨询（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，历任交易管理部交易员、交易

					管理部副总经理（主持工作）。现任固定收益部基金经理，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、英大通盈纯债债券型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《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》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、特定客户资产管理计划等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括公司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、特定客户资产管理计划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 5%的情况，且未发现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

2019 年，央行继续维持稳健的货币政策，通过降准和公开市场操作等方式对冲流动性缺口，维护货币市场流动性“合理充裕”。经济数据方面，在宽货币宽信用政策持续发力、地方债提前发行以及更大规模减税降费政策落地的背景下，经济数据整体呈现前高后低的走势，上半年出现短期企稳迹象，随后中美贸易冲突出现反复，制造业投资、消费、进出口数据乏力带动基本面重归下行通道。下半年猪价暴涨引起通胀大幅上行，市场通胀预期升温，对债市形成扰动，四季度随着经济下行压力有所加大及海外降息周期开启，央行跟随海外市场调降 MLF 及 OMO 利率，货币政策正式开启宽松周期。债券市场短端收益率受资金面难再宽松影响低位徘徊，一年期 AAA 同业存单在 2.95%-3.30%之间波动。中长端债券收益率震荡上行。

同时，2019 年信用违约事件持续高发，尤其是包商银行、北大方正等为代表的银行及 AAA 国企违约的信用风险事件对市场产生了深远的影响，机构投资者风险偏好重归下行，债市流动性将继续维持“总量宽松但结构性紧张”的状态，流动性分层现象将长期存在。

本基金全年保持高评级、低杠杆和适度久期运作，适时调整了债券持仓结构，增加了政策性银行债占比，降低了信用债占比，在信用风险频发的环境下，严控产品信用风险和流动性风险，保持稳健的风格。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末英大纯债债券 A 基金份额净值为 1.1516 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.88%；截至本报告期末英大纯债债券 C 基金份额净值为 1.1320 元，本报告期基金份额净值增长

率为 2.55%；同期业绩比较基准收益率为 1.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，在新冠肺炎疫情冲击下，央行的货币政策预计将更加宽松，公开市场操作将以“总量宽松、价格下调”的方式维持货币市场稳定。新冠肺炎疫情对经济的影响预计主要体现在对消费、出口、制造业和地产销售的冲击上，一季度经济下行压力较大，二、三季度经济基本面在宽松的货币政策和更积极的财政政策的配合下会出现阶段性的企稳回升，四季度经济基本面重回下行。

为减缓新冠肺炎给实体经济带来的冲击，货币、财政政策对冲的力度料将有所加大，监管政策预计也将边际放松，城投再融资政策出现松绑，城投技术性违约风险有但实质性违约概率有所降低；银行的资产负债表在降息降准以及监管边际放松的背景下将有所修复，类包商银行信用风险事件年内很难再看到；而民企的融资环境依然偏紧，信用风险较高。

本基金 2020 年将持续关注央行货币政策、财政政策以及监管政策动向，密切跟踪公开市场操作、资金面和经济基本面走势，采用波段操作策略，适时调整组合久期，同时深入研究精选个券、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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，及时识别合规风险，有效进行风险控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求，研究法规变化对公司业务的影响，督促责任部门落实各项法规要求，使得公司从业人员知法、守法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制；三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性。公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核；四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决。通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是持续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，采用法规解读加案例演示的方式，加深员工对法律法规和 risk 的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有

效落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和运营等内部制度建设情况、内部制度执行情况、各项业务开展的合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，向监管机构报送监察稽核报告。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作；二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形；三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。

4.7 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。估值委员会主任由分管投资的副总经理或实际履行上述职务的其他人员担任；成员包括基金运营部、监察稽核部的负责人及其他根据议题需要指定的相关人员；委员会秘书由基金运营部负责人担任。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未进行利润分配，本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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元的情形。

§ 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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2001403 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	英大纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 34 页的英大纯债债券型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>该基金管理人英大基金管理有限公司对其他信息负责。其他信息包括该基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。该基金 2019 年年度报告预期将在审计报告日后提供给我们。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是在能够获取上述其他信息时阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我</p>

	们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人英大基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人英大基金管理有限公司管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>该基金管理人英大基金管理有限公司治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(3) 评价该基金管理人英大基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人英大基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人英大基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	左艳霞 卜建平
会计师事务所的地址	中国北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2020年3月30日

§ 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,104,840.15	5,740,226.99
结算备付金		-	-
存出保证金		-	19.61
交易性金融资产	7.4.7.2	4,358,280,000.00	457,390,044.23
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,358,280,000.00	457,390,044.23
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	103,438,626.79	8,696,086.95
应收股利		-	-
应收申购款		31,791.18	4,093,335.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,462,855,258.12	475,919,713.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		31,999,864.00	34,999,707.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		868,961.60	1,345,804.38
应付管理人报酬		893,878.60	191,700.84
应付托管费		297,959.51	54,771.68
应付销售服务费		9,851.89	21,136.93
应付交易费用	7.4.7.7	46,652.44	12,180.66
应交税费		-	17,403.82
应付利息		2,172.11	21,165.52

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,039.27	119,453.35
负债合计		34,308,379.42	36,783,324.68
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,846,150,826.96	393,789,736.05
未分配利润	7.4.7.10	582,396,051.74	45,346,652.75
所有者权益合计		4,428,546,878.70	439,136,388.80
负债和所有者权益总计		4,462,855,258.12	475,919,713.48

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 3,846,150,826.96 份。其中 A 类基金份额净值 1.1516 元，基金份额总额 3,815,231,767.92 份；B 类基金份额净值 1.1320 元，基金份额总额 30,919,059.04 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		81,228,408.75	25,015,908.91
1.利息收入		72,622,024.28	14,328,435.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	266,494.14	8,975.31
债券利息收入		70,192,012.22	14,020,215.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,163,517.92	299,244.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,753,886.80	-101,910.57
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,753,886.80	-101,910.57
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	10,252,963.48	10,755,569.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	107,307.79	33,813.91

减：二、费用		13,811,617.46	3,997,191.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,204,915.18	1,904,601.22
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,258,199.05	544,171.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	381,445.16	130,956.09
4. 交易费用	7.4.7.19	45,168.67	12,511.73
5. 利息支出		3,637,758.53	1,218,077.49
其中：卖出回购金融资产支出		3,637,758.53	1,218,077.49
6. 税金及附加		18,541.03	28,946.71
7. 其他费用	7.4.7.20	265,589.84	157,926.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		67,416,791.29	21,018,717.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		67,416,791.29	21,018,717.61

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：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	393,789,736.05	45,346,652.75	439,136,388.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,416,791.29	67,416,791.29
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）	3,452,361,090.91	469,632,607.70	3,921,993,698.61
其中：1. 基金申购款	4,333,967,093.79	581,534,006.02	4,915,501,099.81
2. 基金赎回款	-881,606,002.88	-111,901,398.32	-993,507,401.20
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）	3,846,150,826.96	582,396,051.74	4,428,546,878.70

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/申购的基金分类别。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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求, 同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求, 真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部国家税务总局证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《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》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2) 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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，

不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。免征增值税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	1,104,840.15	5,740,226.99
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,104,840.15	5,740,226.99

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	-	-	
	银行间市场	4,340,344,010.00	4,358,280,000.00	17,935,990.00
	合计	4,340,344,010.00	4,358,280,000.00	17,935,990.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,340,344,010.00	4,358,280,000.00	17,935,990.00	
项目	上年度末 2018年12月31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	32,496,818.94	30,306,044.23	-2,190,774.71
	银行间市场	417,210,198.77	427,084,000.00	9,873,801.23
	合计	449,707,017.71	457,390,044.23	7,683,026.52
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	449,707,017.71	457,390,044.23	7,683,026.52	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	484.13	528.04
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	-	-
应收债券利息	103,434,489.64	8,695,258.02
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	3,653.02	300.89
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	103,438,626.79	8,696,086.95

7.4.7.6 其他资产

注：本期末及上年度末，本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	46,652.44	12,180.66
合计	46,652.44	12,180.66

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	39.27	406.90
预提审计费用	60,000.00	60,000.00
预提信息披露费	120,000.00	50,000.00
预提账户维护费	9,000.00	9,000.00
其他应付款	-	46.45
合计	189,039.27	119,453.35

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

英大纯债债券 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	287,072,369.05	287,072,369.05
本期申购	4,059,483,120.13	4,059,483,120.13
本期赎回（以“-”号填列）	-531,323,721.26	-531,323,721.26
- 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	3,815,231,767.92	3,815,231,767.92

金额单位：人民币元

英大纯债债券 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,717,367.00	106,717,367.00
本期申购	274,483,973.66	274,483,973.66
本期赎回（以“-”号填列）	-350,282,281.62	-350,282,281.62
- 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	30,919,059.04	30,919,059.04

7.4.7.10 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	13,036,112.26	21,228,092.03	34,264,204.29
本期利润	55,428,163.69	11,103,277.82	66,531,441.51
本期基金份额交易产生的变动数	226,656,568.48	250,861,593.77	477,518,162.25
其中：基金申购款	262,872,874.50	288,863,720.92	551,736,595.42
基金赎回款	-36,216,306.02	-38,002,127.15	-74,218,433.17
本期已分配利润	-	-	-

本期末	295,120,844.43	283,192,963.62	578,313,808.05
-----	----------------	----------------	----------------

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	3,215,525.74	7,866,922.72	11,082,448.46
本期利润	1,735,664.12	-850,314.34	885,349.78
本期基金份额交易产生的变动数	-3,155,627.81	-4,729,926.74	-7,885,554.55
其中：基金申购款	8,858,585.18	20,938,825.42	29,797,410.60
基金赎回款	-12,014,212.99	-25,668,752.16	-37,682,965.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,795,562.05	2,286,681.64	4,082,243.69

注：本表涉及报告期内未分配利润的变动项目中，如为利润减少或亏损，以“-”号填列。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	166,875.25	8,535.97
定期存款利息收入	96,250.00	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	126.89
其他	3,368.89	312.45
合计	266,494.14	8,975.31

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31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	-1,753,886.80	-101,910.57

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	-1,753,886.80	-101,910.57

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,503,013,880.18	607,922,192.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,456,357,217.99	592,813,809.63
减：应收利息总额	48,410,548.99	15,210,292.98
买卖债券差价收入	-1,753,886.80	-101,910.57

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
1. 交易性金融资产	10,252,963.48	10,755,569.83
——股票投资	-	-
——债券投资	10,252,963.48	10,755,569.83
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	10,252,963.48	10,755,569.83

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	107,307.79	33,813.91
合计	107,307.79	33,813.91

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
交易所市场交易费用	318.67	111.73
银行间市场交易费用	44,850.00	12,400.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	45,168.67	12,511.73

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	50,000.00
乙类帐户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	30,000.00	-
银行费用	19,589.84	11,926.38
合计	265,589.84	157,926.38

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

2020年3月19日，本基金管理人发布《英大纯债债券型证券投资基金2020年第一次收益分配公告》，对权益登记日在基金管理人登记在册的本基金全体基金份额持有人分配收益。本次分配的收益分配基准日为2020年3月16日，权益登记日、除息日为2020年3月19日，现金红利发放日为2020年3月20日，收益分配方案为按每10份基金份额派发红利人民币0.26元。

除上述情况外，截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
国网英大国际控股集团有限公司	基金管理人的股东
中国交通建设股份有限公司	基金管理人的股东
航天科工财务有限公司	基金管理人的股东
北京英大资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
国网英大国际控股集团有限公司控股子公司	受国网英大国际控股集团有限公司控制的企业

注：于 2019 年 2 月 25 日，原“深圳英大资本管理有限公司”更名为“北京英大资本管理有限公司”，已于 2019 年 2 月 25 日完成工商变更登记手续。

国网英大国际控股集团有限公司控股子公司包括国网国际融资租赁有限公司、英大国际信托有限责任公司、英大证券有限责任公司、英大泰和财产保险股份有限公司、英大泰和人寿保险股份有限公司和英大长安保险经纪有限公司等。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：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。

7.4.10.1.2 债券交易

注：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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：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。

7.4.10.1.4 权证交易

注：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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,204,915.18	1,904,601.22
其中：支付销售机构的客户维护费	234,226.66	142,661.36

注：截至 2019 年 6 月 19 日，支付基金管理人英大基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

自 2019 年 6 月 20 日起，根据本基金份额持有人大会表决通过的《关于英大纯债债券型证券投资基金费率及收益分配有关事项调整的议案》、修订后的《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》，本基金的管理费由原来的 0.70% 的年费率调低为 0.30% 的年费率，变更后本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提，管理费的计算方法如下：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,258,199.05	544,171.68

注：截至 2019 年 6 月 19 日，支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

自 2019 年 6 月 20 日起，根据本基金份额持有人大会表决通过的《关于英大纯债债券型证券投资基金费率及收益分配有关事项调整的议案》、修订后的《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》，本基金的托管费由原来的 0.20%的年费率调低为 0.10%的年费率，变更后本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提，管理费的计算方法如下：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

7.4.10.2.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	182,265.09	182,265.09
中国建设银行股份有限公司	-	8,739.46	8,739.46
-	-	-	-
合计	-	191,004.55	191,004.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	54,049.03	54,049.03
中国建设银行股份有限公司	-	6,801.48	6,801.48
合计	-	60,850.51	60,850.51

注：截至 2019 年 6 月 19 日，支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

英大纯债债券 C 日基金销售服务费=前一日基金资产净值× 0.40% / 当年天数

自 2019 年 6 月 20 日起，根据本基金份额持有人大会表决通过的《关于英大纯债债券型证券投资基金费率及收益分配有关事项调整的议案》、修订后的《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》，本基金的销售服务费由原来的 0.40% 的年费率调低为 0.30% 的年费率，变更后本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提，管理费的计算方法如下：

英大纯债债券 C 日基金销售服务费=前一日基金资产净值× 0.30% / 当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期内及上年度可比期间，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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

英大纯债债券 A				
关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
英大国际信托 有限责任公司	370,862,620.74	9.6400%	177,982,557.62	45.2000%
英大泰和财产 保险股份有限公司	167,844,559.61	4.3600%	-	-
英大泰和人寿 保险股份有限公司	99,416,775.31	2.5800%	-	-
合计	638,123,955.66	16.5900%	177,982,557.62	45.2000%

7.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	1,104,840.15	166,875.25	5,740,226.99	8,535.97

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金。于2019年12月31日的保证金余额为人民币0元（2018年12月31日：19.61元）；2019年12月31日备付金为0元（2018年12月31日：0元）。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：报告期末，本基金未有因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：报告期末，本基金未持有需披露的暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末，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31,999,864.00元。

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
050223	05国开23	2020年1月2日	101.02	337,000	34,043,740.00
合计				337,000	34,043,740.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末及上年度末，本基金未持有交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

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之内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	80,396,000.00
合计	-	80,396,000.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告，以上按短期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。表中列示的未评级债券为超短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本年末及上年末均未持有短期资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本年末及上年末均未持有短期同业存单。

7.4.13.2.4 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	5,404,924.20
AAA 以下	-	24,901,120.03
未评级	-	-
合计	-	30,306,044.23

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本年末及上年末均未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本年末及上年末均未持有长期同业存单。

7.4.13.3 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。

本基金所持有的证券均在银行间本币市场交易，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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在投资端，报告期末，本基金主要持有政策性金融债和现金资产，除应收利息按约定期限变现外，其余各项资产均具有良好的市场流动性，报告期末 7 个交易日可变现资产占净值比例 99%。

在份额端，存在单一机构巨额赎回的可能性。在发生巨额赎回时，本基金将在维护存量持有人和申请赎回持有人利益公平的原则下，审慎确认赎回申请，适当使用《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》中规定的流动性风险管理工具，防范流动性风险发生。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 201 9 年 12	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
---------------------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

月 31 日							
资产							
银行 存款	1,104,840.15	-	-	-	-	-	1,104,840.15
交易性 金融 资产	-	30,030,000. 00	201,020,000. 00	4,127,230,000. 00	-	-	4,358,280,000. 00
应收 利息	-	-	-	-	-	103,438,626. 79	103,438,626.79
应收 申购 款	-	-	-	-	-	31,791.18	31,791.18
资产 总计	1,104,840.15	30,030,000. 00	201,020,000. 00	4,127,230,000. 00	-	103,470,417. 97	4,462,855,258. 12
负债							
卖出 回购 金融 资产 款	31,999,864.0 0	-	-	-	-	-	31,999,864.00
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	868,961.60	868,961.60

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	893,878.60	893,878.60
应付托管费	-	-	-	-	-	297,959.51	297,959.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,851.89	9,851.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	46,652.44	46,652.44
应付利息	-	-	-	-	-	2,172.11	2,172.11
其他负债	-	-	-	-	-	189,039.27	189,039.27
负债总计	31,999,864.00	-	-	-	-	2,308,515.42	34,308,379.42
利率敏感度缺口	-30,895,023.85	30,030,000.00	201,020,000.00	4,127,230,000.00	-	101,161,902.55	4,428,546,878.70
上	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

年度末 2018年 12月 31日							
资产							
银行存款	5,740,226.99	-	-	-	-	-	5,740,226.99
存出保证金	19.61	-	-	-	-	-	19.61
交易性金融资产	15,405,800.00	12,511,747.00	86,644,499.20	16,187,998.03	326,640,000.00	-	457,390,044.23
应收利息	-	-	-	-	-	8,696,086.95	8,696,086.95
应收申购款	-	-	-	-	-	4,093,335.70	4,093,335.70
资产总计	21,146,046.60	12,511,747.00	86,644,499.20	16,187,998.03	326,640,000.00	12,789,422.65	475,919,713.48
负债							
卖出回	34,999,707.50	-	-	-	-	-	34,999,707.50

购金融资产款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,345,804.38	1,345,804.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	191,700.84	191,700.84
应付托管费	-	-	-	-	-	54,771.68	54,771.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,136.93	21,136.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,180.66	12,180.66
应付利息	-	-	-	-	-	21,165.52	21,165.52
应交税费	-	-	-	-	-	17,403.82	17,403.82
其他	-	-	-	-	-	119,453.35	119,453.35

他 负 债							
负 债 总 计	34,999,707.50	-	-	-	-	1,783,617.18	36,783,324.68
利 率 敏 感 度 缺 口	-13,853,660.90	12,511,747.00	86,644,499.20	16,187,998.03	326,640,000.00	11,005,805.47	439,136,388.80

7.4.13.4.1.2 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（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	利率下降 25 个基点	33,949,053.29	8,461,857.99
利率上升 25 个基点	-33,183,859.96	-7,825,192.59	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018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	4,358,280,000.00	98.41	457,390,044.23	104.16
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	4,358,280,000.00	98.41	457,390,044.23	104.16

7.4.13.4.3.2 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（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准的公允价值上升5%	405,528,157.21	25,788,743.61
业绩比较基准的公允价值下降5%	-405,528,157.21	-25,788,743.61	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值（单位：人民币元）	本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）

7.4.14 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,358,280,000.00	97.66
	其中：债券	4,358,280,000.00	97.66
	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	1,104,840.15	0.02
8	其他各项资产	103,470,417.97	2.32
9	合计	4,462,855,258.12	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：报告期末，本基金未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：报告期末，本基金未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：报告期末，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

注：报告期末，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

注：报告期末，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

注：报告期末，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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,358,280,000.00	98.41
	其中：政策性金融债	4,358,280,000.00	98.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,358,280,000.00	98.41

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	190305	19 进出 05	10,200,000	1,021,122,000.00	23.06
2	190203	19 国开 03	4,900,000	491,274,000.00	11.09
3	190208	19 国开 08	4,500,000	452,700,000.00	10.22
4	170206	17 国开 06	4,300,000	440,879,000.00	9.96
5	190207	19 国开 07	3,100,000	312,294,000.00	7.05

8.7 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

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

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

注：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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

经查询上海证券交易所、深圳证券交易所、中国货币网等公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未发现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	103,438,626.79
5	应收申购款	31,791.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	103,470,417.97

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期内未持有股票。

8.11.6 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。

§ 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	1,677	2,275,033.85	3,772,025,877.64	98.87%	43,205,890.28	1.13%
英大纯债债券 C	1,238	24,975.01	-	-	30,919,059.04	100.00%
合计	2,831	1,358,583.83	3,772,025,877.64	98.07%	74,124,949.32	1.93%

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	17,938.41	0.0005%
	英大纯债债券 C	911.66	0.0029%
	合计	18,850.07	0.0005%

9.3 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
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

§ 10 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	287,072,369.05	106,717,367.00
本报告期基金总申购份额	4,059,483,120.13	274,483,973.66
减:本报告期基金总赎回份额	531,323,721.26	350,282,281.62
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	3,815,231,767.92	30,919,059.04

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议表决票收取时间为 2019 年 5 月 22 日起至 2019 年 6 月 17 日 17:00 止，计票时间为 2019 年 6 月 19 日。本次会议表决通过了《关于英大纯债债券型证券投资基金费率及收益分配有关事项调整的议案》，同意调整本基金的管理费率、托管费率、C 类基金份额的销售服务费率、赎回费率及收益分配原则。本次大会决议自 2019 年 6 月 19 日起正式生效，自基金份额持有人大会决议生效后的次日即 2019 年 6 月 20 日起，本基金将执行调整后的基金费率及收益分配原则。

11.2 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 2019 年 5 月 24 日发布公告，自 2019 年 5 月 22 日起，孔旺先生离任英大基金管理有限公司董事长职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 5 月 24 日发布公告，自 2019 年 5 月 22 日起，马晓燕女士新任英大基金管理有限公司董事长职务。

本报告期内，本基金托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 6 月 29 日发布公告，自 2019 年 5 月 16 日起，张大铮先生任英大基金管理有限公司总经理助理（投资总监），自 2019 年 6 月 28 日开始履行高级管理人员职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 8 月 28 日发布公告，自 2019 年 8 月 27 日起，倪枫先生离任英大基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 9 月 20 日发布公告，自 2019 年 9 月 18 日起，刘轶先生离任英大基金管理有限公司督察长职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 10 月 15 日发布公告，自 2019 年 10 月 14 日起，刘康喜先生新任英大基金管理有限公司督察长职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 11 月 14 日发布公告，自 2019 年 11 月 12 日起，柴元春先生离任英大基金管理有限公司副总经理职务。

11.3 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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及

基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更会计师事务所，报告期末本基金应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用为 60,000 元。该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 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，本基金未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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。

11.7.2 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	26,742,977.21	100.00%	-	-	-	-

11.8 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 2018 年年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 1 月 2 日
2	关于民生银行系统维护影响部分交易的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 1 月 17 日
3	英大基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金调整信息披露媒体的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
4	英大纯债债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报及公司网站	2019 年 1 月 22 日
5	英大基金管理有限公司关于增加兴业银行股份有限公司为旗下英大纯债债券型证券投资基金销售机构的公告	中国证券报及公司网站	2019 年 1 月 29 日
6	关于网上交易、手机 APP 因系统升级维护暂停旗下全部基金交易服务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 2 月 25 日
7	英大基金管理有限公司关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 2 月 26 日
8	英大纯债债券型证券投资基金 2018 年度报告及摘要	中国证券报及公司网站	2019 年 3 月 28 日
9	英大基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 4 月 16 日
10	英大纯债债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报及公司网站	2019 年 4 月 18 日
11	英大基金管理有限公司关于	中国证券报、证券时	2019 年 5 月 14 日

	增加北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告	报、上海证券报及公司网站	
12	关于网上交易、手机 APP、微信因系统升级维护暂停旗下全部基金交易服务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 5 月 14 日
13	英大基金管理有限公司关于旗下基金参加中国民生银行直销银行费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 5 月 16 日
14	英大基金管理有限公司关于以通讯方式召开英大纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报及公司网站	2019 年 5 月 16 日
15	英大基金管理有限公司关于以通讯方式召开英大纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报及公司网站	2019 年 5 月 17 日
16	英大基金管理有限公司关于以通讯方式召开英大纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报及公司网站	2019 年 5 月 20 日
17	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 5 月 24 日
18	英大基金管理有限公司关于增加联储证券有限责任公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 5 月 28 日
19	英大纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）及摘要（2019 年第 1 号）	中国证券报及公司网站	2019 年 6 月 6 日
20	英大纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	中国证券报及公司网站	2019 年 6 月 20 日
21	英大纯债债券型证券投资基金合同及托管协议	中国证券报及公司网站	2019 年 6 月 20 日
22	英大基金管理有限公司关于降低定期定额投资计划最低申购金额的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 6 月 21 日
23	英大基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 6 月 21 日
24	英大基金管理有限公司关于	中国证券报、证券时	2019 年 6 月 27 日

	增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	报、上海证券报及公司网站	
25	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年6月29日
26	英大基金关于旗下基金 2019 年半年度最后一个市场交易日资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年7月1日
27	英大基金管理有限公司关于增加上海陆金所基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年7月1日
28	英大基金管理有限公司产品风险等级评价说明(2019年6月)	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年7月1日
29	英大纯债债券型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	中国证券报及公司网站	2019年7月19日
30	英大基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年7月25日
31	英大纯债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告及摘要	中国证券报及公司网站	2019年8月26日
32	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年8月28日
33	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年9月20日
34	英大基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年9月21日
35	英大基金管理有限公司关于增加上海联泰基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年9月26日
36	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年10月15日
37	英大基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年10月22日
38	英大纯债债券型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中国证券报及公司网站	2019年10月24日
39	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公	2019年11月14日

		司网站	
40	英大基金管理有限公司关于修订公司旗下公开募集证券投资基金基金合同信息披露有关条款的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 11 月 23 日
41	英大基金管理有限公司关于更新旗下公募产品招募说明书的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 11 月 23 日
42	英大纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）及摘要（2019 年第 2 号）	中国证券报及公司网站	2019 年 11 月 23 日
43	关于网上交易、手机 APP、微信因系统升级维护暂停旗下全部基金交易服务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 12 月 9 日
44	英大基金管理有限公司关于增加兴业银行股份有限公司为旗下部分产品代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 12 月 11 日
45	英大基金管理有限公司产品风险等级评价说明（2019 年 12 月）	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019. 1. 1-2019. 3. 11	177, 982, 557. 62	192, 880, 063. 12	0. 00	370, 862, 620. 74	9. 64%
	2	2019. 3. 12-2019. 12. 31	0. 00	1, 904, 029, 211. 29	0. 00	1, 904, 029, 211. 29	49. 50%
	3	2019. 5. 29-2019. 9. 24	0. 00	357, 652, 897. 00	0. 00	357, 652, 897. 00	9. 30%
	4	2019. 12. 18-2019. 12. 31	0. 00	872, 218, 927. 17	0. 00	872, 218, 927. 17	22. 68%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

(1) 赎回申请延期办理的风险

持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。

(2) 基金净值大幅波动的风险

当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。

(3) 基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。

(4) 提前终止基金合同的风险

高比例投资者赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

(5) 对重大事项进行投票表决时面临的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

-

§ 13 备查文件目录

13.1 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

报告期内在指定报刊上披露的各项公告

13.2 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

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.ydamc.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人英大基金管理有限公司，客户服务电话：010-57835666、400-890-5288。

英大基金管理有限公司

2020 年 3 月 31 日