

英大安惠纯债债券型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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 2021 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.....	9
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	18
4.10 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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	19
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58

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	58
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	59
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	59
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	59
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.11	投资组合报告附注	59
§9	基金份额持有人信息	61
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	62
§10	开放式基金份额变动	63
§ 11	重大事件揭示	64
11.1	基金份额持有人大会决议	64
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	64
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4	基金投资策略的改变	64
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8	其他重大事件	65
§12	影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	70
§13	备查文件目录	71
13.1	备查文件目录	71
13.2	存放地点	71
13.3	查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	英大安惠纯债债券型证券投资基金		
基金简称	英大安惠纯债		
场内简称	-		
基金主代码	009298		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 4 月 29 日		
基金管理人	英大基金管理有限公司		
基金托管人	中国光大银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	5,000,521,059.13 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	英大安惠纯债 A	英大安惠纯债 C	英大安惠纯债 E
下属分级基金的场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	009298	009299	013543
报告期末下属分级基金份额总额	5,000,345,172.84 份	175,886.29 份	0.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持较好流动性的基础上，力争获得超过业绩比较基准的投资收益。		
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	中债综合全价（总值）指数收益率		
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。		
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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘康喜	石立平
	联系电话	010-59112026	010-63639180
	电子邮箱	liukx@ydamc.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-890-5288	95595

传真	010-59112222	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	100020	100033
法定代表人	马晓燕	李晓鹏

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	2021 年			2020 年 4 月 29 日(基金合同生效 日)-2020 年 12 月 31 日			2019 年		
	英大安惠纯债 A	英大安惠 纯债 C	英大 安惠 纯债 E	英大安惠纯债 A	英大安惠 纯债 C	英大 安惠 纯债 E	英大 安惠 纯债 A	英大 安惠 纯债 C	英大 安惠 纯债 E
本期 已实 现收 益	129,960,601.81	7,366.33	0.00	88,428,959.78	35,903.22	-	-	-	-
本期 利润	149,350,138.84	8,467.51	0.00	85,772,250.74	11,485.36	-	-	-	-
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.0287	0.0250	0.000 0	0.0092	0.0023	-	-	-	-
本 期 加 权 平 均 净 值 利 润 率	2.81%	2.46%	0.00%	0.92%	0.23%	-	-	-	-
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	3.00%	2.70%	0.00%	1.48%	1.27%	-	-	-	-
3.1. 2 期 末	2021 年末			2020 年末			2019 年末		

数据和指标									
期末可供分配利润	116,688,296.74	3,185.34	-	59,515,451.60	3,720.22	-	-	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0233	0.0181	-	0.0084	0.0063	-	-	-	-
期末基金资产净值	5,175,496,600.97	181,119.88	-	7,183,781,500.11	594,536.41	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0350	1.0298	-	1.0148	1.0127	-	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2021 年末			2020 年末			2019 年末		
基金份额累计净值增长率	4.52%	4.00%	0.00%	1.48%	1.27%	-	-	-	-

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。

5、在任何一个工作日 E 类基金份额为零时，E 类基金份额净值以 A 类基金份额净值与 E 类份额成立后单位分红金额之和作为参考净值。本报告期 E 类基金份额为零，期末参考份额净值为 1.0350。

3.2 基金净值表现

3.1.1 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

英大安惠纯债 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	0.79%	0.02%	0.60%	0.05%	0.19%	-0.03%
过去六个月	1.65%	0.02%	1.44%	0.05%	0.21%	-0.03%
过去一年	3.00%	0.03%	2.10%	0.05%	0.90%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.52%	0.05%	-0.77%	0.06%	5.29%	-0.01%

英大安惠纯债 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	0.71%	0.02%	0.60%	0.05%	0.11%	-0.03%
过去六个月	1.50%	0.02%	1.44%	0.05%	0.06%	-0.03%
过去一年	2.70%	0.03%	2.10%	0.05%	0.60%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.00%	0.05%	-0.77%	0.06%	4.77%	-0.01%

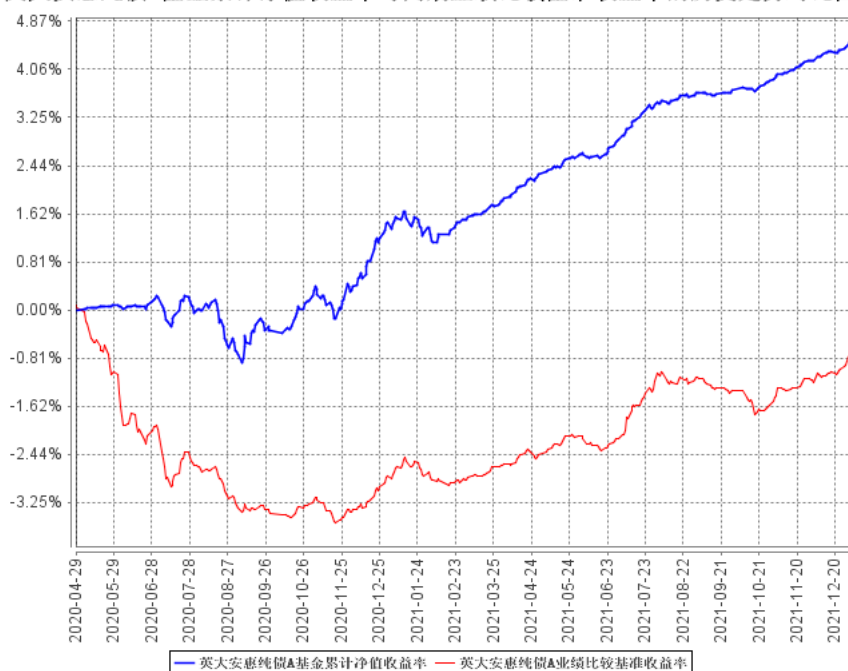
英大安惠纯债 E

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
-	-	-	-	-	-	-

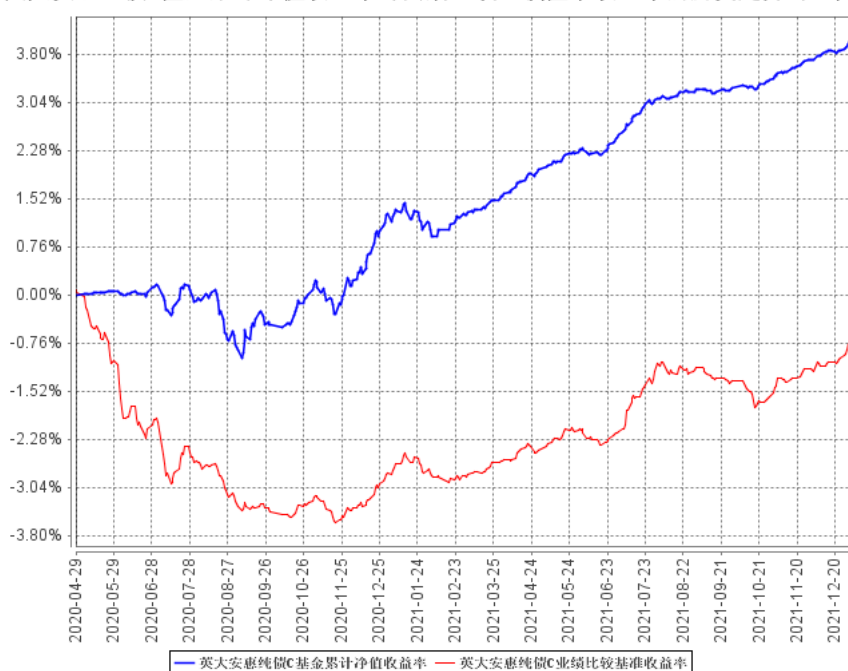
注：同期业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率。

3.1.2 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

英大安惠纯债A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

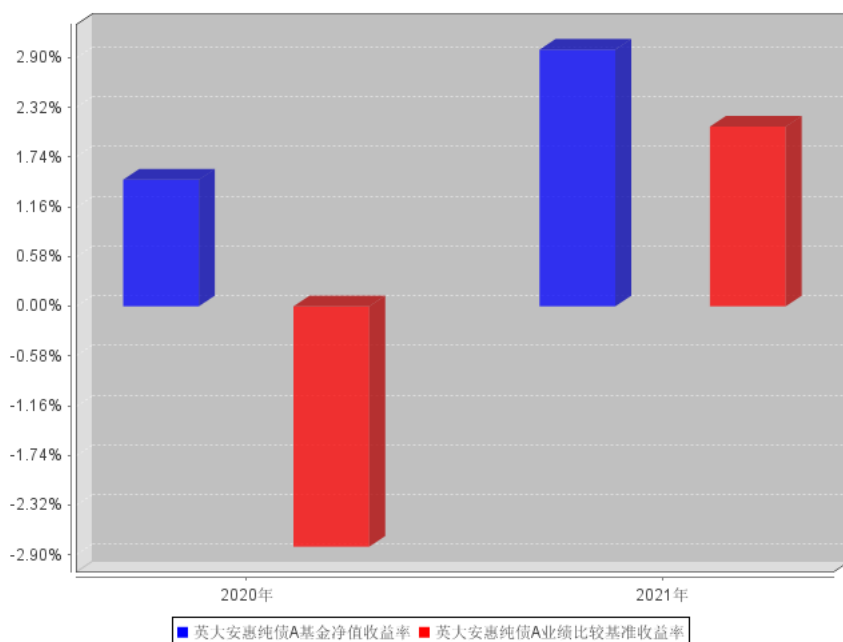


英大安惠纯债C基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

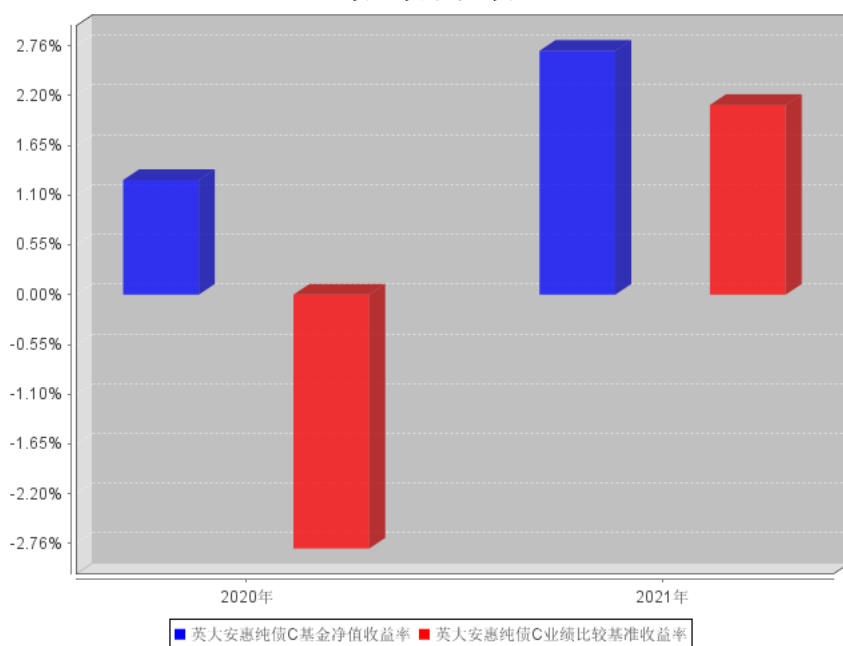


3.1.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大安惠纯债A自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



英大安惠纯债C自基金合同生效以来基金每年净值收益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

单位：人民币元

其他指标	报告期（2021年1月1日至2021年12月31日）
-	-

其他指标	报告期末（2021年12月31日）
-	-

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

英大安惠纯债 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
2021	0.1000	50,000,745.60	3,305.91	50,004,051.51	
2020	-	-	-	-	
合计	0.1000	50,000,745.60	3,305.91	50,004,051.51	

单位：人民币元

英大安惠纯债 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
2021	0.1000	4,726.61	230.20	4,956.81	
2020	-	-	-	-	
合计	0.1000	4,726.61	230.20	4,956.81	

注：E类基金份额期末为0，本持有期内未进行利润分配。

§ 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

英大基金管理有限公司（简称“英大基金”）成立于 2012 年 8 月 17 日，注册资本金 11.46 亿元，是国网英大国际控股集团有限公司的全资子公司，实际控制人为国家电网有限公司。英大基金依托股东优势，坚持市场化发展方向，立足新发展阶段、贯彻新发展理念，根植主业、服务实业、坚持能源特色、努力创造价值，积极构建规模、速度、结构、质量、效益、安全“六统一”的新发展格局，致力于为客户提供卓越的资产管理服务。

自 2019 年实施战略转型以来，英大基金成功迈入发展快车道，2021 年末管理资产规模 1022 亿元，年增长 223%。主动管理能力与业务规模同步提升，依托高效的决策机制、专业的投研团队、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。2020 年获评新浪财经“最具成长基金公司”金麒麟奖、东方财富风云榜“最具潜力基金公司”奖。2021 年获评第十届金融界领航中国金智奖之“杰出新锐基金公司”奖。

截至 2021 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、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金 14 只证券投资基金，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		
易祺坤	本基金基金经理	2020 年 4 月 29 日	-	10	北京大学理学学士。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)。现任固定收益部总经理助理、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、英大纯债债券型证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
张大铮	本基金基金经理	2020 年 4 月 29 日	-	19	香港中文大学工商管理硕士。历任中银国际证券有限责任公司高级分析员，中国国际金融有限公司固定收益部副总经理、资产管理部副总经理，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司助理总经理、固定收益投资部总监，民生基金管理有限公司(筹)副总裁。2019 年 5 月加入英大基金，曾任总经理助理（投资总监），现任副总经理兼固定收益部总经理，英大纯债债券型证券投资基金、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、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券

					投资基金、英大智享债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

无。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《英大安惠纯债债券型证券投资基金基金合同》、《英大安惠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，基金运作无重大违法违规行为，无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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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、私募资产管理计划、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、私募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。

风险管理部定期对公司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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

2021 年债券市场收益率呈现震荡下行走势。年初，流动性延续宽松，随后海外复工复产带动通胀预期发酵叠加春节临近，央行在 1 月底提前回收流动性，资金面遭受冲击，债券收益率小幅上行。二季度央行没有主动收紧流动性，叠加地方债供给节奏偏慢，资金面整体超预期宽松，在基本面走弱的背景下，各期限收益率均明显下行。7 月初央行超预期全面降准 0.5%，带动收益率进一步下行，但市场对于宽信用、逆周期调节的预期也逐渐增强，另外海外通胀持续创新高，美联储货币政策收紧预期走强，债市收益率底部回升。年底国内经济基本面下行压力进一步增大，央行 12 月 15 日全面降准，随后中央经济工作会议召开，市场对于年底至明年一季度资金面宽松预期增强，降息预期升温，债市收益率再次探底。

报告期内，本基金维持了较低的仓位和较短的久期，再投资过程中始终秉持低杠杆、短久期、高评级原则。在信用风险频发的环境下，严控产品的信用风险，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安惠纯债 A 基金份额净值为 1.0350 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.00%；截至本报告期末英大安惠纯债 C 基金份额净值为 1.0298 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.70%；本报告期内，基金份额持有人未实际持有本基金 E 类份额。

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 2022 年，债券市场面临一定不确定性，大概率呈震荡走势，同时波动将会加大。一季度稳增长诉求较强，政策前移使得一季度将成为各项刺激政策发力的重要时间窗口，地方债发行的提速也将继续拉动社融同比增速触底回升，宽信用政策的逐步落地将带动利率回升。地产政策底已过，在稳增长的目标下，地产投资明年大概率边际稳定向好。整体信用环境改善预期增强，市场风险偏好或进一步提升。另一方面，货币环境大概率配合财政政策维持较为宽松，降准降息仍有操作空间，宽松的货币环境大概率会制约利率的上行幅度。本基金在运作时会更加关注资金面的变化，动态调整仓位和久期，在严控产品信用风险和流动性风险的同时，为持有人带来稳定的投资收益。

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。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进行披露。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。估值委员会主任由公司总经理担任；成员包括督察长、投资总监、运营分管领导、各基金经理、研究部、交易部、监察稽核部、风险管理部、基金运营部的主要负责人；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

本报告期内本基金实施了一次利润分配，英大安惠 A 于 2021 年 4 月 27 日每 10 份基金份额分红 0.1 元，现金形式发放总额为 50,000,745.60 元，再投资形式发放总额为 3,305.91 元，本期利润分配合计为 50,004,051.51 元，英大安惠 C 于 2021 年 4 月 27 日每 10 份基金份额分红 0.1 元，现金形式发放总额为 4,726.61 元，再投资形式发放总额为 230.20 元，本期利润分配合计为 4,956.81 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

报告期内，中国光大银行股份有限公司在英大安惠纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本托管人认为，英大基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《英大安惠纯债债券型证券投资基金 2021 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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 2203887 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	英大安惠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>我们审计了后附的英大安惠纯债债券型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</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（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2021 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。</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，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人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及财务报表附注 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，基金管理人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>基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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) 评价基金管理人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) 对基金管理人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>我们与基金管理人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	2022年3月30日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：英大安惠纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	480,531.43	278,337.32
结算备付金		-	-
存出保证金		-	0.76
交易性金融资产	7.4.7.2	4,737,964,000.00	7,264,626,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,737,964,000.00	7,264,626,000.00
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	380,000,890.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	59,216,064.32	104,657,673.48
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,177,661,485.75	7,369,562,011.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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		-	183,023,605.46
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,316,276.62	1,422,026.25
应付托管费		438,758.86	474,008.74
应付销售服务费		46.19	251.32
应付交易费用	7.4.7.7	29,683.23	109,437.26
应交税费		-	-
应付利息		-	16,646.01

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	199,000.00	140,000.00
负债合计		1,983,764.90	185,185,975.04
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	5,000,521,059.13	7,079,913,273.95
未分配利润	7.4.7.10	175,156,661.72	104,462,762.57
所有者权益合计		5,175,677,720.85	7,184,376,036.52
负债和所有者权益总计		5,177,661,485.75	7,369,562,011.56

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，英大安惠纯债 A 净值 1.0350 元，基金份额总额 5,000,345,172.84 份，英大安惠纯债 C 净值 1.0298 元，基金份额总额 175,886.29 份，英大安惠纯债 E 净值 1.0350 元，基金份额总额 0.00 份，总份额合计 5,000,521,059.13 份。

7.2 利润表

会计主体：英大安惠纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 29 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		174,788,577.06	137,442,912.56
1. 利息收入		164,233,656.74	196,219,759.03
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,825.66	19,121,025.27
债券利息收入		160,975,082.40	167,529,270.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,244,748.68	9,569,463.26
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,835,717.92	-56,095,801.30
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	-8,835,717.92	-56,095,801.30
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	19,390,638.21	-2,681,126.90
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	0.03	81.73

减：二、费用		25,429,970.71	51,659,176.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	15,916,366.04	18,808,624.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,305,455.44	6,269,541.31
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,048.23	10,152.55
4. 交易费用	7.4.7.19	48,785.00	114,400.22
5. 利息支出		3,922,516.00	26,305,558.30
其中：卖出回购金融资产支出		3,922,516.00	26,305,558.30
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	235,800.00	150,900.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		149,358,606.35	85,783,736.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		149,358,606.35	85,783,736.10

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：英大安惠纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	7,079,913,273.95	104,462,762.57	7,184,376,036.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	149,358,606.35	149,358,606.35
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）	-2,079,392,214.82	-28,655,698.88	-2,108,047,913.70
其中：1. 基金申购款	4,687.82	58.12	4,745.94
2. 基金赎回款	-2,079,396,902.64	-28,655,757.00	-2,108,052,659.64
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）	-	-50,009,008.32	-50,009,008.32
五、期末所有者权益（基金净值）	5,000,521,059.13	175,156,661.72	5,175,677,720.85

项目	上年度可比期间 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 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)	10,015,022,284.39	-	10,015,022,284.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	85,783,736.10	85,783,736.10
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)	-2,935,109,010.44	18,679,026.47	-2,916,429,983.97
其中: 1. 基金申购款	1,629,129,401.74	21,392,334.68	1,650,521,736.42
2. 基金赎回款	-4,564,238,412.18	-2,713,308.21	-4,566,951,720.39
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)	7,079,913,273.95	104,462,762.57	7,184,376,036.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3 财务报表由下列负责人签署:

 马晓燕 岳喜伟 李婷
 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 基金基本情况

英大安惠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[2020]第 462 号《关于准予英大安惠纯债债券型证券投资基金注册的批复》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《英大安惠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 10,015,021,622.22 元,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2000443 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《英大安惠纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,015,022,284.39 份基金份额(其中英大安惠纯债 A 基金份额为 10,001,837,016.49 份,英大安惠纯债 C 基金份额为 13,185,267.90 份),认购资金利息折合 662.17 份基金份额(其中英

大安惠纯债 A 基金份额为 116.27 份，英大英大安惠纯债 C 基金份额为 545.90 份)。本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《英大安惠纯债债券型证券投资基金基金合同》和《英大安惠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。本基金自 2021 年 9 月 10 日起在现有基金份额的基础上增设 E 类基金份额，原 A 类基金份额和 C 类基金份额保持不变。A 类基金份额、E 类基金份额在投资者申购时收取申购费，不从本类别资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费，从本类别基金资产中计提销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大安惠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，包括债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、国债期货、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款）、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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。本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。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〈年度和中期报告〉》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 2021 年 12 月 31 日的财务状况、自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间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。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近

交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计

算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(未弥补亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实

际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去相应类别的每单位基金份额收益分配金额后均不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本期末未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)、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:

(a)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。

(b) 资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品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，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。

(c) 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。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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。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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 对基金在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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	480,531.43	278,337.32
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：	480,531.43	278,337.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	4,721,254,488.69	4,737,964,000.00	16,709,511.31
	合计	4,721,254,488.69	4,737,964,000.00	16,709,511.31
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,721,254,488.69	4,737,964,000.00	16,709,511.31	
项目	上年度末 2020 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	7,267,307,126.90	7,264,626,000.00	-2,681,126.90
	合计	7,267,307,126.90	7,264,626,000.00	-2,681,126.90
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	7,267,307,126.90	7,264,626,000.00	-2,681,126.90	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本年末及上年末均未持有任何衍生金融资产 /（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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	380,000,890.00	-
合计	380,000,890.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期内无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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	276.97	161.99
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	59,116,096.43	104,657,511.49
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	99,690.92	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	59,216,064.32	104,657,673.48

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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	29,683.23	109,437.26
合计	29,683.23	109,437.26

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费用	70,000.00	70,000.00
预提信息披露费	120,000.00	70,000.00
预提账户维护费	9,000.00	-
合计	199,000.00	140,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

英大安惠纯债 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,079,326,171.01	7,079,326,171.01
本期申购	3,433.29	3,433.29
本期赎回(以“-”号填列)	-2,078,984,431.46	-2,078,984,431.46
- 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	5,000,345,172.84	5,000,345,172.84

金额单位：人民币元

英大安惠纯债 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	587,102.94	587,102.94
本期申购	1,254.53	1,254.53
本期赎回(以“-”号填列)	-412,471.18	-412,471.18
- 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	175,886.29	175,886.29

金额单位：人民币元

英大安惠纯债 E		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	-	-

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

英大安惠纯债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	59,515,451.60	44,939,877.50	104,455,329.10
本期利润	129,960,601.81	19,389,537.03	149,350,138.84
本期基金份额交易产生的变动数	-22,783,705.16	-5,866,283.14	-28,649,988.30
其中：基金申购款	22.84	19.61	42.45
基金赎回款	-22,783,728.00	-5,866,302.75	-28,650,030.75
本期已分配利润	-50,004,051.51	-	-50,004,051.51
本期末	116,688,296.74	58,463,131.39	175,151,428.13

单位：人民币元

英大安惠纯债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,720.22	3,713.25	7,433.47
本期利润	7,366.33	1,101.18	8,467.51
本期基金份额交易产生的变动数	-2,944.40	-2,766.18	-5,710.58
其中：基金申购款	6.75	8.92	15.67
基金赎回款	-2,951.15	-2,775.10	-5,726.25
本期已分配利润	-4,956.81	-	-4,956.81
本期末	3,185.34	2,048.25	5,233.59

单位：人民币元

英大安惠纯债 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-	-	-
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-	-	-

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 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年4月29日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
活期存款利息收入	13,825.66	1,605,608.52
定期存款利息收入	-	17,515,416.67
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	0.08
其他	-	-
合计	13,825.66	19,121,025.27

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 股票投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金在本报告期内无股票投资收益。

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 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年4月29日(基金合 同生效日)至2020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	-8,835,717.92	-56,095,801.30
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	-8,835,717.92	-56,095,801.30

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 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年4月29日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,340,137,556.43	7,268,510,596.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,228,916,586.53	7,197,079,747.37
减：应收利息总额	120,056,687.82	127,526,650.55
买卖债券差价收入	-8,835,717.92	-56,095,801.30

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本年度及上年度均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本年度及上年度均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期内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：本基金在本年度及上年度均无贵金属投资收益。

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：本基金在本年度及上年度均无贵金属赎回差价收入。

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：本基金在本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期内无衍生工具收益其他收益投资。

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 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年4月29日(基金合同 生效日)至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	19,390,638.21	-2,681,126.90
——股票投资	-	-
——债券投资	19,390,638.21	-2,681,126.90
——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	19,390,638.21	-2,681,126.90

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 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年4月29日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
基金赎回费收入	0.03	81.73
合计	0.03	81.73

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年4月29日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
交易所市场交易费用	-	0.22
银行间市场交易费用	48,785.00	114,400.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	48,785.00	114,400.22

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年4月29日(基金合同生 效日)至2020年12月31日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	70,000.00
证券出借违约金	-	-
乙类帐户维护费	45,800.00	10,500.00
其他	-	400.00
合计	235,800.00	150,900.00

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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无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
光大银行股份有限公司	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（注）	受国网英大国际控股集团有限公司控制的企业

注：1. 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。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过交易。

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：本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期内未通过关联方的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：本基金在本报告期内没有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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年4月29日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,916,366.04	18,808,624.08
其中：支付销售机构的客户维护费	696.92	3,336.42

注：支付基金管理人英大基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数

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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年4月29日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,305,455.44	6,269,541.31

注：支付基金管理人光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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			
	2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	英大安惠纯债 A	英大安惠纯债 C	英大安惠纯债 E	合计
英大基金管理有限公司	-	127.25	-	127.25
光大银行股	-	125.58	-	125.58

份有限公司				
英大证券有 限责任公司	-	778.43	-	778.43
合计	-	1,031.26	-	1,031.26
获得销售服 务费的 各关联方名 称	上年度可比期间 2020年4月29日(基金合同生效日)至2020年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	英大安惠纯债 A	英大安惠纯债 C	英大安惠纯债 E	合计
英大基金管 理有限公司	-	136.82	-	136.82
光大银行股 份有限公司	-	3,286.76	-	3,286.76
英大证券有 限责任公司	-	6,517.86	-	6,517.86
合计	-	9,941.44	-	9,941.44

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

英大安惠纯债 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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020年4月29日(基金合同生效日)至2020年12月31日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
光大银行股 份有限公司	90,144,336.16	-	-	-	1,357,101,000.00	337,180.69

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况****7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况****7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

注：本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

7.4.10.6 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	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年4月29日(基金合同生效日)至2020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
光大银行股份有限公司	480,531.43	13,825.66	278,337.32	1,605,608.52

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

英大安惠纯债 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	2021 年 4 月 27 日	-	2021 年 4 月 27 日	0.1000	50,000,745.60	3,305.91	50,004,051.51	
合计	-	-		0.1000	50,000,745.60	3,305.91	50,004,051.51	

英大安惠纯债 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	2021 年 4 月 27 日	-	2021 年 4 月 27 日	0.1000	4,726.61	230.20	4,956.81	
合计	-	-		0.1000	4,726.61	230.20	4,956.81	

注：E 类基金份额期末为 0，本持有期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021 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：于 2021 年 12 月 31 日，基金无因认购新发或增发证券而于期末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：于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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、风险管理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。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。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；本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并采用券款对付交割方式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

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	1,152,776,000.00	-
AAA 以下	249,985,000.00	-
未评级	-	-
合计	1,402,761,000.00	-

注：1. 长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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。

本基金所持有的证券主要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。

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

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金流动性受限资产比例、持仓集中度等指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本报告期末，本基金所持证券主要在证券交易所市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。

本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 1年 12 月 31	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
---	-------	-------	--------	------	------------------	-----	----

日						
资产						
银行存款	480,531.43	-	-	-	-	480,531.43
交易性金融资产	-	170,017,000.00	1,579,647,000.00	2,988,300,000.00	-	4,737,964,000.00
买入返售金融资产	380,000,890.00	-	-	-	-	380,000,890.00
应收利息	-	-	-	-	59,216,064.32	59,216,064.32
资产总计	380,481,421.43	170,017,000.00	1,579,647,000.00	2,988,300,000.00	59,216,064.32	5,177,661,485.75
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,316,276.62	1,316,276.62
应付托管费	-	-	-	-	438,758.86	438,758.86
应	-	-	-	-	46.19	46.19

付销售服务费							
应付交易费用		-	-	-	-	29,683.23	29,683.23
其他负债		-	-	-	-	199,000.00	199,000.00
负债总计		-	-	-	-	1,983,764.90	1,983,764.90
利率敏感度缺口	380,481,421.43	170,017,000.00	1,579,647,000.00	2,988,300,000.00	-	57,232,299.42	5,175,677,720.85
上年度末 2020 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	278,337.32	-	-	-	-	-	278,337.32
存出	0.76	-	-	-	-	-	0.76

保证金						
交易性金融资产		-	360,223,000.00	6,904,403,000.00	-	7,264,626,000.00
应收利息		-			-	104,657,673.48
资产总计	278,338.08	-	360,223,000.00	6,904,403,000.00	-	7,369,562,011.56
负债						
卖出回购金融资产款	183,023,605.46	-			-	183,023,605.46
应付管理人报酬		-			-	1,422,026.25
应付托管费		-			-	474,008.74
应付销售		-			-	251.32

服务费						
应付交易费用		-	-	-	109,437.26	109,437.26
应付利息		-	-	-	16,646.01	16,646.01
其他负债		-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	183,023,605.46	-	-	-	2,162,369.58	185,185,975.04
利率敏感度缺口	-182,745,267.38	-	360,223,000.00	6,904,403,000.00	-102,495,303.90	7,184,376,036.52

注：本表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	利率下降 25 个基点	15,679,750.59	47,447,886.80
利率上升 25 个基点	-15,481,066.57	-46,487,571.37	

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	4,737,964,000.00	91.54	7,264,626,000.00	101.12
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	4,737,964,000.00	91.54	7,264,626,000.00	101.12

注：无

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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准的公允价值上升 5%	133,104,764.52	207,460,553.64
业绩比较基准的公允价值下降 5%	-133,104,764.52	-207,460,553.64	

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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

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	4,737,964,000.00	91.51
	其中：债券	4,737,964,000.00	91.51
	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	380,000,890.00	7.34
	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	480,531.43	0.01
8	其他各项资产	59,216,064.32	1.14
9	合计	5,177,661,485.75	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

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	-	-

注：报告期末（2021年12月31日），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：本基金本报告期内未持有股票。

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：本基金本报告期内未持有股票。

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：本基金本报告期内未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

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	4,737,964,000.00	91.54
	其中：政策性金融债	3,335,203,000.00	64.44
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	4,737,964,000.00	91.54

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

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	190214	19 国开 14	9,100,000	915,096,000.00	17.68
2	2028031	20 渤海银行小微债	4,500,000	453,060,000.00	8.75
3	092018003	20 农发清发 03	4,500,000	452,835,000.00	8.75
4	2028027	20 中国银行 01	3,300,000	332,904,000.00	6.43
5	200207	20 国开 07	3,000,000	302,520,000.00	5.85

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：本基金本报告期内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：本基金本报告期内未持贵金属

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

注：本基金本报告期内未持有权证。

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

本基金不参与国债期货投资。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金不参与国债期货投资。

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，除以下情形外，未出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。

中国银行：2021 年 5 月 17 日，因地方政府购买服务项目贷款不合规等三十六条违法违规事实被中国银保监会处以罚款 8761.355 万元。

中国农业发展银行：2021 年 1 月 29 日，因未办理建筑工程施工许可证进行建设，乌审旗住房和城乡建设局依据《建筑工程施工许可管理办法》第十二条，对中国农业发展银行乌审旗支行处以罚款 2479.3 元。

渤海银行：2021 年 5 月 21 日，因地方政府购买服务项目贷款不合规等被中国银保监会处以罚款 9720 万元。

建设银行：2021 年 8 月 13 日，因占压财政存款或者资金；违反账户管理规定，被中国人民银行处以警告并处罚款 388 万元。2021 年 6 月 21 日，因虚拟货币炒作问题被中国人民银行约谈。

基金管理人通过对上述发行人进一步了解分析后，认为以上处罚不会对所持有证券的投资价值构成实质性影响。

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

本期内本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定，也均在基金的备选股票池之内。

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	59,216,064.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,216,064.32

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：本基金本报告期末未持有股票。

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
英大安惠纯债 A	62	80,650,728.59	4,999,999,166.26	99.99%	346,006.58	0.01%
英大安惠纯债 C	170	1,034.63	928.16	0.53%	174,958.13	99.47%
英大安惠纯债 E	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	225	22,224,538.04	5,000,000,094.42	99.99%	520,964.71	0.01%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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）。

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	英大安惠纯债 A	11,268.71	0.0002%
	英大安惠纯债 C	29,000.12	16.4880%
	英大安惠纯债 E	0.00	0.0000%
	合计	40,268.83	0.0008%

注：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）。

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	英大安惠纯债 A	0~10
	英大安惠纯债 C	0~10
	英大安惠纯债 E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	英大安惠纯债 A	0
	英大安惠纯债 C	0~10
	英大安惠纯债 E	0

	合计	0~10
--	----	------

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大安惠纯债 A	英大安惠纯债 C	英大安惠纯债 E
基金合同生效日（2020 年 4 月 29 日）基金份额总额	10,001,837,016.49	13,185,267.90	-
本报告期期初基金份额总额	7,079,326,171.01	587,102.94	-
本报告期基金总申购份额	3,433.29	1,254.53	-
减：本报告期基金总赎回份额	2,078,984,431.46	412,471.18	-
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	5,000,345,172.84	175,886.29	-

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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，英大基金管理有限公司于 2021 年 2 月 27 日发布公告，自 2021 年 2 月 25 日起，党晶先生任英大基金管理有限公司总经理助理，履行高级管理人员职务。

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

本报告期内本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

报告期内本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本年度审计费用为 70,000 元。本次会计师事务所的聘任已经基金管理人董事会批准，并履行了必要的程序。

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	
兴业证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，公司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

		例		成交总额 的比例		比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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	英大基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021年1月8日
2	英大安惠纯债债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021年1月21日
3	英大基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告的提示性公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021年1月21日
4	关于提高英大安惠纯债债券型证券投资基金份额净值精度的公告	公司网站；中国证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021年2月2日
5	英大基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021年2月6日
6	英大基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021年2月24日
7	英大基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务规则的公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021年2月26日
8	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021年2月27日
9	英大基金管理有限公司关于调整	公司网站；中国证券	2021年3月19日

	旗下开放式基金代销渠道交易限额的公告	报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	
10	英大基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告的提示性公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 3 月 30 日
11	英大安惠纯债债券型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 3 月 30 日
12	英大基金管理有限公司关于旗下基金参加珠海盈米基金销售有限公司基金费率优惠活动的公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 2 日
13	英大基金关于暂停直销渠道“T+0 赎回提现业务”服务的通知	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 8 日
14	英大基金管理有限公司关于增加宜信普泽为代销机构的公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 9 日
15	英大基金管理有限公司关于旗下部分公募基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 16 日
16	英大安惠纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 16 日
17	英大安惠纯债债券型证券投资基金基金合同	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 16 日
18	英大安惠纯债债券型证券投资基金托管协议	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 16 日
19	英大安惠纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2021 年第 1 号）	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 16 日
20	英大基金管理有限公司旗下基金	公司网站；中国证券	2021 年 4 月 20 日

	2021 年第 1 季度报告的提示性公告	报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	
21	英大安惠纯债债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 20 日
22	英大基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 21 日
23	关于“乐言”、“创维娱乐”等 APP 下单任务与英大基金管理有限公司无关的声明	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 24 日
24	英大安惠纯债债券型证券投资基金 2021 年第一次收益分配公告	公司网站；中国证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 24 日
25	关于英大安惠纯债债券型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	公司网站；中国证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 4 月 24 日
26	关于英大基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增代销机构的公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 5 月 6 日
27	英大基金管理有限公司关于增加一路财富（北京）基金销售有限公司为代销机构的公告	公司网站；中国证券报；上海证券报；证券时报；证券日报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 6 月 2 日
28	英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明（2021 年 06 月）	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 6 月 30 日
29	英大基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告	公司网站；证券时报；中国证券报；证券日报；上海证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 7 月 6 日
30	英大基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告的提示性公告	公司网站；证券时报；中国证券报；证券日报；上海证券	2021 年 7 月 20 日

		报;中国证监会电子 信息披露平台	
31	英大安惠纯债债券型证券投资基金 2021 年第二季度报告	公司网站;中国证监 会电子信息披露平 台	2021 年 7 月 20 日
32	英大基金管理有限公司关于旗下 部分产品参与招商证券申购费率 优惠活动的公告	公司网站;中国证 券报;上海证券报;证 券时报;中国证监会 电子信息披露平台	2021 年 7 月 30 日
33	英大基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告的提示性公告	公司网站;证券时 报;中国证券报;证 券日报;上海证券 报;中国证监会电 子信息披露平台	2021 年 8 月 28 日
34	英大安惠纯债债券型证券投资基金 2021 年中期报告	公司网站;中国证监 会电子信息披露平 台	2021 年 8 月 28 日
35	英大基金管理有限公司关于增加 北京新浪仓石基金销售有限公司 为代销机构的公告	公司网站;证券时 报;中国证券报;上 海证券报;中国证 监会电子信息披露 平台	2021 年 8 月 30 日
36	英大基金管理有限公司关于旗下 部分产品参与中信证券等代销机 构费率优惠活动的公告	公司网站;证券时 报;中国证券报;上 海证券报;中国证 监会电子信息披露 平台	2021 年 8 月 31 日
37	关于英大安惠纯债债券型证券投 资基金增设 E 类基金份额并相应 修订法律文件的公告	公司网站;中国证 券报;中国证监会 电子信息披露平 台	2021 年 9 月 10 日
38	英大安惠纯债债券型证券投资基金 托管协议更新	公司网站;中国证 监会电子信息披露 平台	2021 年 9 月 10 日
39	英大安惠纯债债券型证券投资基金 基金合同更新	公司网站;中国证 监会电子信息披露 平台	2021 年 9 月 10 日
40	英大安惠纯债债券型证券投资基金 招募说明书(更新)(2021 年 第 2 号)	公司网站;中国证 监会电子信息披露 平台	2021 年 9 月 10 日
41	英大安惠纯债债券型证券投资基金 (C 类份额)基金产品资料概 要(更新)	公司网站;中国证 监会电子信息披露 平台	2021 年 9 月 10 日
42	英大安惠纯债债券型证券投资基金 (A 类份额)基金产品资料概	公司网站;中国证 监会电子信息披露平	2021 年 9 月 10 日

	要（更新）	台	
43	英大安惠纯债债券型证券投资基金（E 类份额）基金产品资料概要	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 9 月 10 日
44	英大基金管理有限公司关于增加北京度小满基金销售有限公司为代销机构的公告	公司网站；证券时报；中国证券报；上海证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 9 月 15 日
45	英大基金管理有限公司关于旗下部分产品参与中国光大银行申购费率优惠活动的公告	公司网站；中国证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 10 月 15 日
46	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旗下部分基金销售机构的公告	公司网站；中国证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 10 月 21 日
47	英大基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告的提示性公告	公司网站；证券时报；中国证券报；证券日报；上海证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 10 月 26 日
48	英大安惠纯债债券型证券投资基金 2021 年第三季度报告	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 10 月 26 日
49	英大基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	公司网站；证券时报；中国证券报；上海证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 11 月 25 日
50	英大基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告	公司网站；证券时报；中国证券报；上海证券报；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 12 月 24 日
51	英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明（2021 年 12 月）	公司网站；中国证监会电子信息披露平台	2021 年 12 月 30 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	20210101 - 20211231	4,999,999,000.00	-	-	4,999,999,000.00	99.99%
	2	20210101 - 20210202	2,078,685,729.16	-	2,078,685,729.16	-	-
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

无

§ 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

《英大安惠纯债债券型证券投资基金基金合同》

《英大安惠纯债债券型证券投资基金托管协议》

《英大安惠纯债债券型证券投资基金招募说明书》

《英大安惠纯债债券型证券投资基金产品资料概要》

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

2022 年 3 月 30 日