

# 英大通惠多利债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>52</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
7.3 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.....	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 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.....	53
7.7 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.....	53
7.8 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.....	53
7.9 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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.11 投资组合报告附注.....	54
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 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
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
10.2 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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>
11.1 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.....	62

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	英大通惠多利债券型证券投资基金	
基金简称	英大通惠多利债券	
场内简称	-	
基金主代码	012352	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 18 日	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,001,826,322.58 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:	英大通惠多利债券 A	英大通惠多利债券 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	012352	012353
报告期末下属分级基金的份额总额	999,698,162.95 份	2,128,159.63 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力求获得超越业绩比较基准的投资回报,追求基金资产的长期稳健增值。	
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。主要策略有:久期策略、期限结构策略、类属资产配置策略、信用债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、资产支持证券投资策略等。	
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,其长期平均风险和预期收益率低于股票型及混合型基金,高于货币市场基金。	
	英大通惠多利债券 A	英大通惠多利债券 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘康喜
	联系电话	010-59112026
		陆志俊
		95559

	电子邮箱	liukx@ydamc.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-890-5288	95559
传真		010-59112222	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		100020	200336
法定代表人		马晓燕	任德奇

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ydamc.com">http://www.ydamc.com</a>
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	英大通惠多利债券 A	英大通惠多利债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	17,411,136.69	60,336.89
本期利润	15,586,144.22	8,910.75
加权平均基金份额本期利润	0.0156	0.0024
本期加权平均净值利润率	1.52%	0.23%
本期基金份额净值增长率	1.53%	1.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	31,094,801.08	65,585.29
期末可供分配基金份额利润	0.0311	0.0308
期末基金资产净值	1,031,532,871.25	2,195,920.57
期末基金份额净值	1.0318	1.0318
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.18%	3.18%

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报告期末最后一自然日（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

英大通惠多利债券 A

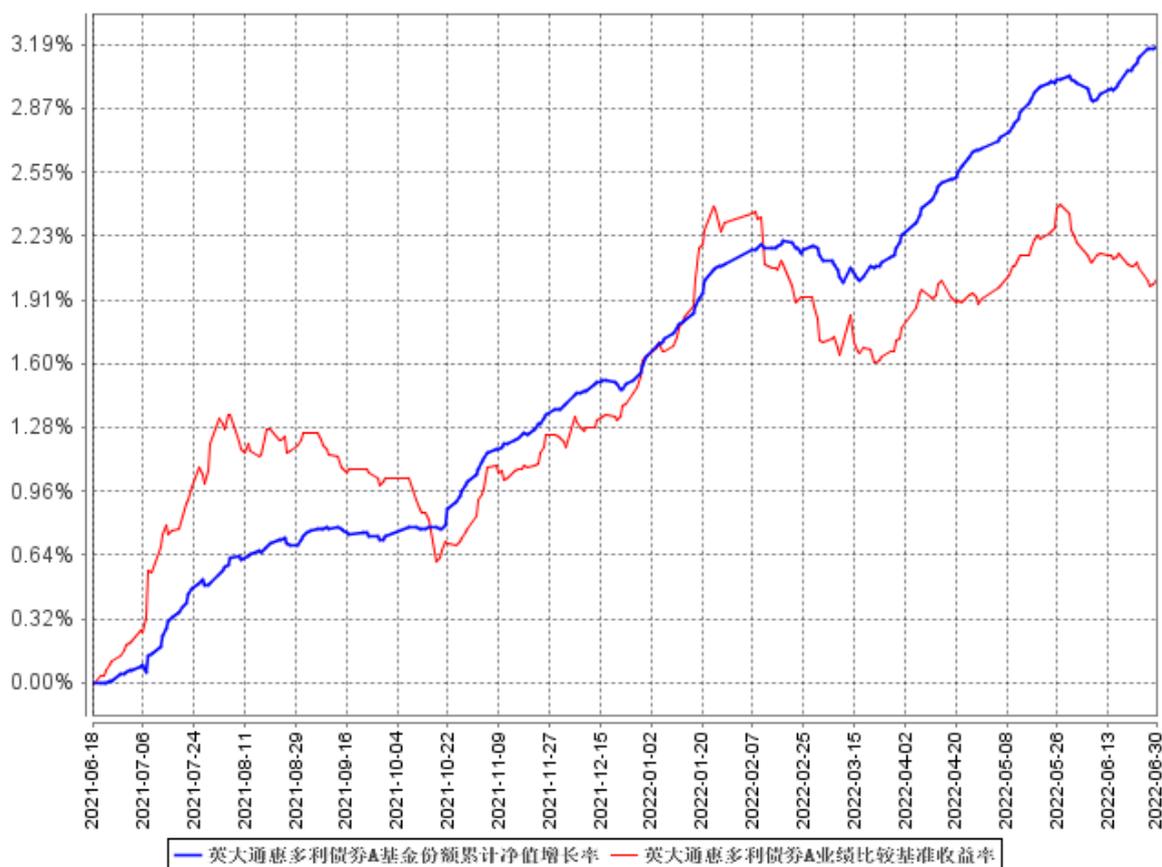
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.16%	0.02%	-0.24%	0.03%	0.40%	-0.01%
过去三个月	0.96%	0.02%	0.29%	0.04%	0.67%	-0.02%
过去六个月	1.53%	0.02%	0.38%	0.05%	1.15%	-0.03%
过去一年	3.13%	0.02%	1.83%	0.05%	1.30%	-0.03%
自基金合同生效起至今	3.18%	0.02%	2.02%	0.05%	1.16%	-0.03%

## 英大通惠多利债券 C

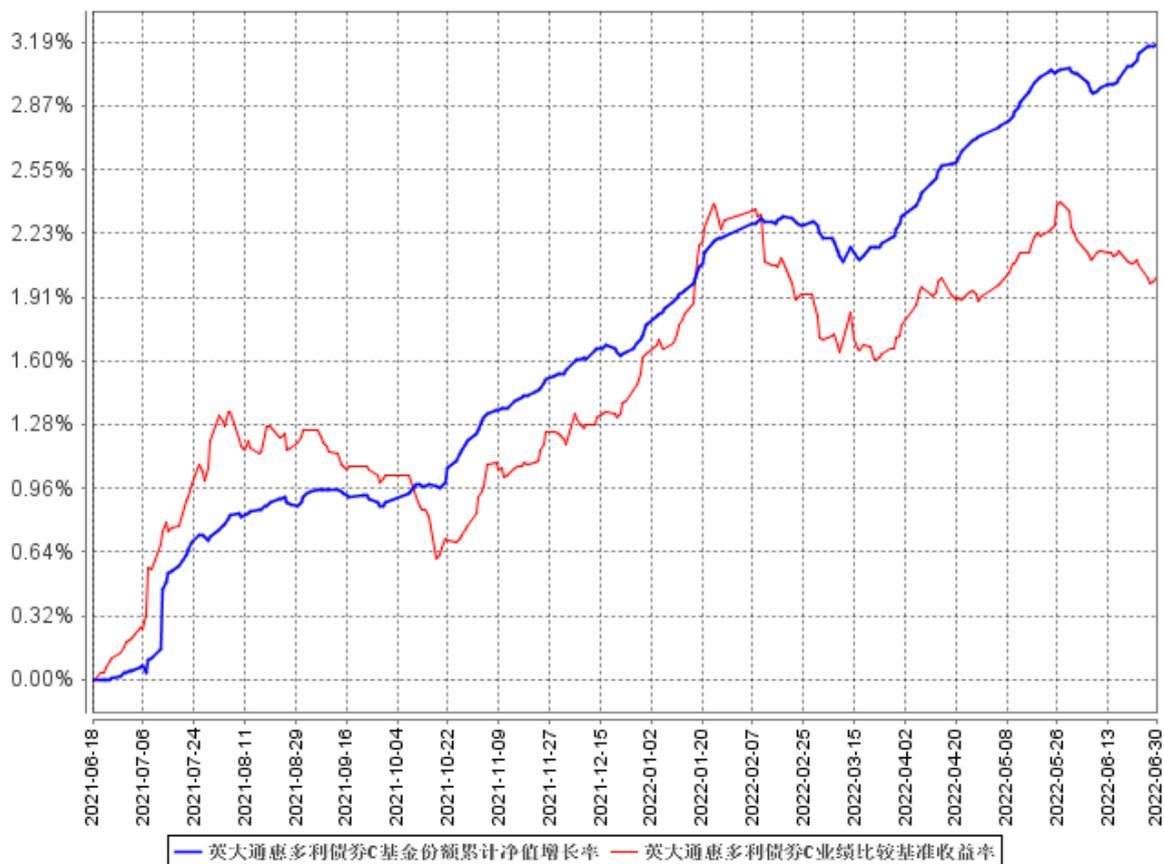
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.14%	0.02%	-0.24%	0.03%	0.38%	-0.01%
过去三个月	0.88%	0.02%	0.29%	0.04%	0.59%	-0.02%
过去六个月	1.39%	0.02%	0.38%	0.05%	1.01%	-0.03%
过去一年	3.15%	0.03%	1.83%	0.05%	1.32%	-0.02%
自基金合同生效起至今	3.18%	0.03%	2.02%	0.05%	1.16%	-0.02%

### 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

英大通惠多利债券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



英大通惠多利债券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



### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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“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 2022 年 6 月 30 日，本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先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、英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金、英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、英大安益中短债债券型证券投资基金、英大安悦纯债债券型证券投资基金 18 只开放式证券投资基金，同时，管理多个特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易祺坤	本基金基金经理	2021 年 6 月 18 日	-	11	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，英大纯债债券型证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金基金经理、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	2021 年 6 月 18 日	-	20	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，英大纯债债券型证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、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、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决

定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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

### 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《英大通惠多利债券型证券投资基金基金合同》《英大通惠多利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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且不存在其他可能导致不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

2022 年一季度，稳增长政策集中发力，出口高位回落，海外疫情反复使得出口仍有韧性，价格因素推升投资，居民消费有所改善。多地房贷利率下调，地产政策边际放松，但 3 月开始疫情出现反复，经济下行压力加大。1 月中，1 年 MLF 和 7 天 OMO 利率同步下调 10BP，随后 1 年期 LPR 下调 5BP，5 年期 LPR 下调 5BP，债券收益率探底。年后海外通胀高企，美联储货币政策收紧预期进一步走强，国内宽信用预期加深，3 月再次降息预期落空，债市收益率快速上行。随后金融委会议召开，货币宽松预期再次升温，收益率重回下行。

二季度稳增长政策继续发力，基建维持高增，地产调控政策边际持续放松。4 月疫情全国散点爆发，部分城市经济停摆使得经济下行压力较大，生产、消费均受疫情拖累，出口增速回落。5-6 月复工复产逐步推进，经济底部反弹。货币政策方面，4 月初国常会提及降准，市场对于货币

政策宽松预期较强，4月15日全面降准25BP。降准幅度不及预期以及一季度经济数据向好带动收益率整体上行，1年国债最高上行至2.06%，10年国债最高上行至2.85%。4月底北京疫情爆发，叠加资金面超预期宽松，债券收益率重回下行。5月20日5年期LPR下调15BP，债券收益率再次探底，1年国债最低下行至1.91%，10年国债最低下行至2.70%。随后全国稳住经济大盘会议召开，经济企稳预期走强，债市收益率反弹。

报告期内，本基金整体维持较低的组合久期，配置标的主要关注短久期短融和高等级信用债。在信用风险频发的环境下，严控产品的信用风险，保持稳健风格。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末英大通惠多利债券 A 基金份额净值为 1.0318 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.53%；截至本报告期末英大通惠多利债券 C 基金份额净值为 1.0318 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.39%；同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 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 年下半年，债券市场面临不确定性升高，大概率承压。国内方面，稳增长诉求仍然较强，财政政策仍将推动基建维持高增，地产或持续边际放松推动投资回暖。经济复苏或将持续，基本面边际改善动力较强，市场风险偏好或再度提升。另一方面，通胀在猪周期带动下或重回视野，海外美联储加息叠加缩表，欧洲央行启动加息，将对目前宽松的货币环境形成一定制约。全球债市收益率上行，国内仍面临一定资本外流压力，将对债市形成扰动。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。估值委员会主任由公司总经理担任；成员包括督察长、投资总监、运营分管领导及基金运营部、监察稽核部、风险管理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历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期本基金未进行利润分配，本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

## § 5 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

本报告期内，基金托管人在英大通惠多利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，英大基金管理有限公司在英大通惠多利债券型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由英大基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关英大通惠多利债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：英大通惠多利债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	521,059.77	3,733,391.55
结算备付金		266,099.62	-
存出保证金		7,212.07	15,819.91
交易性金融资产	6.4.7.2	1,154,516,554.81	1,204,285,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,094,661,734.53	1,164,245,000.00
资产支持证券投资		59,854,820.28	40,040,000.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	5.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	18,937,283.50
资产总计		1,155,310,926.27	1,226,971,499.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		121,011,602.74	210,272,334.87
应付清算款		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		254,502.41	258,671.18
应付托管费		84,834.12	86,223.71
应付销售服务费		540.34	211.40
应付投资顾问费		-	-
应交税费		107,298.28	65,137.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	123,356.56	200,942.49
负债合计		121,582,134.45	210,883,521.19
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,001,826,322.58	999,837,499.95
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	31,902,469.24	16,250,478.82
净资产合计		1,033,728,791.82	1,016,087,978.77
负债和净资产总计		1,155,310,926.27	1,226,971,499.96

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，英大通惠多利债券 A 基金份额净值 1.0318 元，基金份额总额 999,698,162.95 份；英大通惠多利债券 C 基金份额净值 1.0318 元，基金份额总额 2,128,159.63 份。英大通惠多利债券份额总额合计为 1,001,826,322.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：英大通惠多利债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 18 日(基金 合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		20,275,109.80	278,006.64
1.利息收入		8,135.18	278,006.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,135.18	172,860.60
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	105,146.04
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,143,393.23	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	21,413,702.63	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	729,690.60	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,876,418.61	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		4,680,054.83	54,911.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,528,284.10	31,247.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	509,428.03	10,415.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,237.24	2,150.15
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,452,024.89	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,452,024.89	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		59,743.97	-
8. 其他费用	6.4.7.23	125,336.60	11,098.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		15,595,054.97	223,095.02
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		15,595,054.97	223,095.02
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		15,595,054.97	223,095.02

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：英大通惠多利债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	999,837,499.95	-	16,250,478.82	1,016,087,978.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	999,837,499.95	-	16,250,478.82	1,016,087,978.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,988,822.63	-	15,651,990.42	17,640,813.05
(一)、综合收益总额	-	-	15,595,054.97	15,595,054.97
(二)、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)	1,988,822.63	-	56,935.45	2,045,758.08
其中：1.基金申购款	41,421,516.02	-	954,225.10	42,375,741.12
2.基金赎回款	-39,432,693.39	-	-897,289.65	-40,329,983.04
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,001,826,322.58	-	31,902,469.24	1,033,728,791.82
项目	上年度可比期间 2021年6月18日(基金合同生效日)至2021年6月30日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	210,124,898.31	-	0.00	210,124,898.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,849,216,408.65	-	1,013,293.75	1,850,229,702.40
(一)、综合收益总额	-	-	223,095.02	223,095.02
(二)、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)	1,849,216,408.65	-	790,198.73	1,850,006,607.38
其中: 1.基金申购款	1,999,208,518.66	-	799,681.34	2,000,008,200.00
2.基金赎回款	-149,992,110.01	-	-9,482.61	-150,001,592.62
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,059,341,306.96	-	1,013,293.75	2,060,354,600.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

马晓燕

基金管理人负责人

岳喜伟

主管会计工作负责人

李婷

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

英大通惠多利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[2021]第 1493 号《关于准予英大通惠多利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《英大通惠多利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 210,124,898.31 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 2100700 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《英大通惠多利债券型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额(含利息转份额)为 210,124,898.31 份基金份额(其中英大通惠多利债券 A 基金份额(含利息转份额)为 179,993,300.25 份,英大通惠多利债券 C 基金份额(含利息转份额)为 30,131,598.06 份)。本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《英大通惠多利债券型证券投资基金基金合同》和《英大通惠多利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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大通惠多利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分、证券公司短期公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、通知存款以及定期存款等其他银行存款)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。

本基金不主动从二级市场购买股票等权益类资产,被动持有的股票等权益类资产,自该资产可以上市交易之日起 10 个交易日内卖出。本基金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:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。每个交易日日终,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。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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 6.4.2 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况及 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外,本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

#### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金已自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

#### (i) 金融工具的分类影响

#### 以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、应收利息、应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 3,733,391.55 元、15,819.91 元、18,937,283.50 元、5.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 3,733,583.40 元、15,827.72 元、5.00 元。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 1,204,285,000.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 1,223,222,083.84 元。

#### 以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 210,272,334.87 元、258,671.18 元、86,223.71 元、211.40 元、36,373.95 元、14,568.54 元、150,000.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 210,286,903.41 元、258,671.18 元、86,223.71 元、211.40 元、186,373.95 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结

算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金 2022 年年初留存收益产生重大影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	521,059.77
等于：本金	520,786.38
加：应计利息	273.39
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	521,059.77

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	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	342,180,753.41	2,907,484.93	345,997,484.93	909,246.59
	银行间市场	737,874,727.01	11,157,249.60	748,664,249.60	-367,727.01

	合计	1,080,055,480.42	14,064,734.53	1,094,661,734.53	541,519.58
资产支持证券		58,861,548.47	839,820.28	59,854,820.28	153,451.53
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,138,917,028.89	14,904,554.81	1,154,516,554.81	694,971.11

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本报告期末，本基金未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本报告期末，本基金未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本报告期末，本基金无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本报告期末，本基金无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

### 6.4.7.8 其他资产

注：本报告期末，本基金未持有其他资产。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30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	-
应付交易费用	25,096.41
其中：交易所市场	25,096.41
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	98,260.15
预提审计费用	-
预提信息披露费	-
合计	123,356.56

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

英大通惠多利债券 A
------------

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
本期期初	999,658,470.99	999,658,470.99
本期申购	97,098.81	97,098.81
本期赎回(以“-”号填列)	-57,406.85	-57,406.85
- 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	999,698,162.95	999,698,162.95

金额单位：人民币元

英大通惠多利债券 C		
项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
本期期初	179,028.96	179,028.96
本期申购	41,324,417.21	41,324,417.21
本期赎回(以“-”号填列)	-39,375,286.54	-39,375,286.54
- 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	2,128,159.63	2,128,159.63

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

英大通惠多利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	13,682,638.80	2,564,667.48	16,247,306.28
本期利润	17,411,136.69	-1,824,992.47	15,586,144.22
本期基金份额交易产生的变动数	1,025.59	232.21	1,257.80
其中：基金申购款	2,668.47	262.69	2,931.16
基金赎回款	-1,642.88	-30.48	-1,673.36

本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,094,801.08	739,907.22	31,834,708.30

单位：人民币元

英大通惠多利债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,662.74	509.80	3,172.54
本期利润	60,336.89	-51,426.14	8,910.75
本期基金份额交易产生的变动数	2,585.66	53,091.99	55,677.65
其中：基金申购款	757,912.46	193,381.48	951,293.94
基金赎回款	-755,326.80	-140,289.49	-895,616.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,585.29	2,175.65	67,760.94

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。

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,263.73
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	815.70
其他	55.75
合计	8,135.18

注：其他指结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本报告期，本基金无股票投资收益。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	20,772,818.39
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	640,884.24
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	21,413,702.63

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	394,237,247.03
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	385,709,955.20
减：应计利息总额	7,883,002.50
减：交易费用	3,405.09
买卖债券差价收入	640,884.24

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本报告期，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本报告期，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	729,690.60
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-

资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	729,690.60

#### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本报告期，本基金无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本报告期，本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本报告期，本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本报告期，本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本报告期，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本报告期，本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

注：本报告期，本基金无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,876,418.61
——股票投资	-
——债券投资	-1,989,870.14
——资产支持证券投资	113,451.53
——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	-1,876,418.61

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

**6.4.7.21 其他收入**

注：本报告期，本基金无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本报告期，本基金未发生信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
乙类帐户维护费	18,600.00
银行间账户维护费	9,000.00
银行费用	8,476.45
合计	125,336.60

**6.4.7.24 分部报告**

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
交通银行股份有限公司	基金托管人
国网英大国际控股集团有限公司	基金管理人的股东
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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生关联方交易。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 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。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年6月18日(基金合同生效日)至 2021年6月30日	
	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 成交总额的比例

英大证券有限责任公	151,340,392.87	100.00%	-	-
-----------	----------------	---------	---	---

### 6.4.10.1.3 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。

### 6.4.10.1.4 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。

### 6.4.10.1.5 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。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年6月18日(基金合同生效日) 至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,528,284.10	31,247.28
其中：支付销售机构的客户维护费	1,123.73	2.68

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年6月18日(基金合同生效日) 至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	509,428.03	10,415.75

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每

月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 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 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大通惠多利债券 A	英大通惠多利债券C	合计
英大基金管理有限公司	-	1.81	1.81
英大证券有限责任公司	-	5,126.88	5,126.88
合计	-	5,128.69	5,128.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年6月18日(基金合同生效日)至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大通惠多利债券 A	英大通惠多利债券C	合计
英大基金管理有限公司	-	2,137.33	2,137.33
英大证券有限责任公司	-	12.60	12.60
合计	-	2,149.93	2,149.93

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数

### 6.4.10.3 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。

### 6.4.10.4 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

#### 6.4.10.4.1 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

#### 6.4.10.4.2 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

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 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。

**6.4.10.5.2 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**

份额单位：份

英大通惠多利债券 A				
关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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
交通银行股份 有限公司	999,599,160.34	99.7800%	999,599,160.34	99.9800%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

**6.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 6 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有 限公司	521,059.77	7,263.73	436,266,304.82	70,638.36

注：本基金通过“交通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 2022 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 273,311.69 元。(2021 年 6 月 30 日：人民币 0 元)

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**6.4.10.8 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。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末，本基金未持有因认购新发/期末持有的暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 121,011,602.74 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
101753017	17 华能 MTN001	2022 年 7 月 1 日	104.63	500,000	52,314,463.01
102100611	21 华侨城 MTN001	2022 年 7 月 1 日	102.28	500,000	51,139,000.00
102000542	20 张江集 MTN001	2022 年 7 月 1 日	101.25	274,000	27,742,912.87
合计				1,274,000	131,196,375.88

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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、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。

#### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	-
A-1 以下	0.00	-
未评级	50,985,547.95	50,050,000.00
合计	50,985,547.95	50,050,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为超短期融资券。

3. 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。

**6.4.13.2.2 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。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
AAA	49,982,724.66	194,474,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	49,982,724.66	194,474,000.00

注：短期信用评级（同业存单的主体评级）由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

**6.4.13.2.4 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	848,473,246.57	779,327,000.00
AAA 以下	0.00	-
未评级	102,972,465.76	80,400,000.00
合计	951,445,712.33	859,727,000.00

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。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	40,993,227.40	40,040,000.00
AAA 以下	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	40,993,227.40	40,040,000.00

注：长期信用评级（同业存单的主体评级）由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 6.4.13.2.6 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。

#### 6.4.13.3 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证券交易所市场交易，因此，除在附注 6.4.12 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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

#### 6.4.13.3.2 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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金在报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 2年 6月 30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	521,059.77	-	-	-	-	-	521,059.77
结算备付金	266,099.62	-	-	-	-	-	266,099.62
存出保证金	7,208.87	-	-	-	-	3.20	7,212.07
交易性金融资产	153,282,735.62	-	-428,527,366.57	562,337,112.89	10,369,339.73	-	-1,154,516,554.81
资	154,077,103.88	0.00	428,527,366.57	562,337,112.89	10,369,339.73	3.20	1,155,310,926.27

产总计			7	9	3		7
负债							
卖出回购金融资产款	121,011,602.74	-	-	-	-	-	121,011,602.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	254,502.41	254,502.41
应付托管费	-	-	-	-	-	84,834.12	84,834.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	540.34	540.34
应交税费	-	-	-	-	-	107,298.28	107,298.28
其他负债	-	-	-	-	-	123,356.56	123,356.56
负债总计	121,011,602.74	0.00	0.00	0.00	0.00	570,531.71	121,582,134.45

计							
利率敏感 度缺口	33,065,501.14	0.00	428,527,366.57	562,337,112.89	10,369,339.73	-570,528.51	1,033,728,791.82
上年度末 2021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	3,733,391.55	-	-	-	-	-	3,733,391.55
存出 保证金	15,819.91	-	-	-	-	-	15,819.91
交易性 金融资产	40,544,000.00	69,245,000.00	427,599,000.00	666,897,000.00	-	-	1,204,285,000.00
应收 利息	-	-	-	-	-	18,937,283.50	18,937,283.50
应收 申购	-	-	-	-	-	5.00	5.00

款							
资产总计	44,293,211.46	69,245,000.00	427,599,000.00	666,897,000.00	0.00	18,937,288.50	1,226,971,499.96
负债							
卖出回购金融资产款	210,272,334.87	-	-	-	-	-	210,272,334.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	258,671.18	258,671.18
应付托管费	-	-	-	-	-	86,223.71	86,223.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	211.40	211.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	36,373.95	36,373.95
应付利息	-	-	-	-	-	14,568.54	14,568.54

息							
应交税费						65,137.54	65,137.54
其他负债						150,000.00	150,000.00
负债总计	210,272,334.87	0.00	0.00	0.00	0.00	611,186.32	210,883,521.19
利率敏感度缺口	-165,979,123.41	69,245,000.00	427,599,000.00	666,897,000.00	0.00	18,326,102.18	1,016,087,978.77

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

#### 6.4.13.4.1.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	利率平行下降 25 个基点	2,801,644.23	3,266,311.61
利率平行上升 25 个基点	-2,770,318.61	-3,227,891.96	

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	1,094,661,734.53	105.89	1,204,285,000.00	118.52
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	59,854,820.28	5.79	-	-
合计	1,154,516,554.81	111.68	1,204,285,000.00	118.52

#### 6.4.13.4.3.2 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准的公允价值上升 5%	12,461,564.45	8,264,772.01
业绩比较基准的公允价值下	-12,461,564.45	-8,264,772.01	

	降 5%		
--	------	--	--

#### 6.4.13.4.4 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 ( 2022 年 6 月 30 日 )	上年度末 ( 2021 年 12 月 31 日 )
	-	-	-
	合计	-	-

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值: 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	1, 154, 516, 554. 81	-
第三层次	-	-
合计	1, 154, 516, 554. 81	-

#### **6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

无。

#### **6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：无)。

#### **6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### **6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	1,154,516,554.81	99.93
	其中：债券	1,094,661,734.53	94.75
	资产支持证券	59,854,820.28	5.18
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	787,159.39	0.07
8	其他各项资产	7,212.07	0.00
9	合计	1,155,310,926.27	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资组合。

#### 7.2.2 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。

### 7.3 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：本报告期末，本基金未持有股票投资。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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：本报告期末，本基金未持有股票投资。

#### 7.4.2 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：本报告期末，本基金未持有股票投资。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本报告期末，本基金未持有股票投资。

## 7.5 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	71,478,682.20	6.91
	其中：政策性金融债	61,109,342.47	5.91
4	企业债券	398,027,375.34	38.50
5	企业短期融资券	50,985,547.95	4.93
6	中期票据	524,187,404.38	50.71
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	49,982,724.66	4.84
9	其他	-	-
10	合计	1,094,661,734.53	105.89

## 7.6 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	152590	20 京投 03	800,000	82,867,730.41	8.02
2	102101311	21 中化股 MTN002	800,000	82,777,643.84	8.01
3	149530	21 赣水 01	700,000	70,949,403.29	6.86
4	160417	16 农发 17	600,000	61,109,342.47	5.91
5	101753017	17 华能 MTN001	500,000	52,314,463.01	5.06

## 7.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	193333	21 电 1A2	400,000	40,993,227.40	3.97
2	2189172	21 安鑫 1A1	500,000	18,861,592.88	1.82

注：本报告期末，本基金仅持有以上 2 只资产支持证券。

## 7.8 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投资。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

16 农发 17：2022 年 3 月 21 日，中国农业发展银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为被银保监会罚款。

20 深圳水务 MTN001：2021 年 12 月 11 日，深圳水务因未依法履行职责被深圳市交通运输局罚款。

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。

### 7.11.2 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

本报告期内本基金未持有股票。

### 7.11.3 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	7,212.07
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,212.07

#### **7.11.4 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。

#### **7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### **7.11.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
英大通惠多利债券 A	46	21,732,568.76	999,599,160.34	99.99%	99,002.61	0.01%
英大通惠多利债券 C	246	8,651.06	30,997.24	1.46%	2,097,162.39	98.54%
合计	289	3,466,527.07	999,630,157.58	99.78%	2,196,165.00	0.22%

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）。

### 8.2 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	英大通惠多利债券 A	419.39	0.0000%
	英大通惠多利债券 C	680.94	0.0320%
	合计	1,100.33	0.0001%

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）。

### 8.3 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	英大通惠多利债券 A	0~10

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	英大通惠多利债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	英大通惠多利债券 A	0~10
	英大通惠多利债券 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大通惠多利债券 A	英大通惠多利债券 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 18 日）基金份额总额	179,993,300.25	30,131,598.06
本报告期期初基金份额总额	999,658,470.99	179,028.96
本报告期基金总申购份额	97,098.81	41,324,417.21
减：本报告期基金总赎回份额	57,406.85	39,375,286.54
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	999,698,162.95	2,128,159.63

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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 2022 年 3 月 12 日发布公告，自 2022 年 3 月 11 日起，党晶先生新任英大基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 10.3 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，本基金管理人无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略没有发生改变。

### 10.5 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审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
英大证券有限责任公司	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。

#### 10.7.2 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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比例		券回购成交总额的比例		成交总额的比例
英大证券有限责任公司	151,340,392.87	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会指定媒介	2022年1月1日
2	英大基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2022年1月22日
3	英大通惠多利债券型证券投资基金 2021 年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2022年1月22日
4	英大基金管理有限公司关于增加东方财富证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定媒介	2022年1月27日
5	英大基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定媒介	2022年2月23日
6	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定媒介	2022年3月12日
7	英大基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京中植基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2022年3月25日
8	英大基金管理有限公司关于参加中信建投证券股份有限公司申购费率（含定期定额投资）优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2022年3月25日
9	英大基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2022年3月30日
10	英大通惠多利债券型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定媒介	2022年3月30日
11	英大基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2022年4月21日
12	英大通惠多利债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2022年4月21日
13	关于终止北京植信基金销售	中国证监会指定媒介	2022年4月22日

	有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	介	
14	关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 4 月 22 日
15	英大基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 5 月 6 日
16	英大基金管理有限公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 5 月 10 日
17	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	中国证监会指定媒介	2022 年 5 月 25 日
18	英大基金管理有限公司关于下线英大财富宝 APP 运营及维护服务的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 5 月 28 日
19	英大通惠多利债券型证券投资基金（英大通惠多利债券 C 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定媒介	2022 年 6 月 2 日
20	英大通惠多利债券型证券投资基金（英大通惠多利债券 A 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定媒介	2022 年 6 月 2 日
21	英大基金管理有限公司关于旗下基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会指定媒介	2022 年 6 月 2 日
22	英大通惠多利债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2022 年第 1 号）	中国证监会指定媒介	2022 年 6 月 2 日
23	英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 6 月 15 日
24	英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明（2022 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2022 年 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20220101 - 20220630	999,599,160.34	-	-	999,599,160.34	99.78%
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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准英大通惠多利债券型证券投资基金设立的文件

《英大通惠多利债券型证券投资基金基金合同》

《英大通惠多利债券型证券投资基金托管协议》

《英大通惠多利债券型证券投资基金招募说明书》

《英大通惠多利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

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：<http://www.ydamc.com/>

英大基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日