英大纯债债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大纯债债券		
基金主代码	650001		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 4 月 24 日		
报告期末基金份额总额	817,230,296.91 份		
投资目标	本基金投资于固定收益类资产，在有效控制投资组合风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，追求长期稳定的投资回报。		
投资策略	本基金依据宏观经济运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场收益特征，分析判断市场利率水平变动趋势，并预测下一阶段的利率水平，结合各类别资产的收益性、风险性和流动性特征，进行大类资产配置。主要投资策略包括久期策略、期限结构策略、类属资产配置策略、辅助策略。		
业绩比较基准	中债综合指数		
风险收益特征	本基金为债券型基金，该类基金长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，但高于货币市场基金，属于中低风险和收益水平的投资品种。		
基金管理人	英大基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	英大纯债债券 A	英大纯债债券 C	英大纯债债券 E
下属分级基金的交易代码	650001	650002	013587
报告期末下属分级基金的份额总额	700,722,281.42 份	16,229,088.80 份	100,278,926.69 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）		
	英大纯债债券 A	英大纯债债券 C	英大纯债债券 E
1.本期已实现收益	3,225,239.82	65,238.19	482,481.96
2.本期利润	1,859,238.83	31,118.46	296,433.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0026	0.0017	0.0028
4.期末基金资产净值	829,334,591.04	18,944,240.15	121,205,793.45
5.期末基金份额净值	1.1835	1.1673	1.2087

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大纯债债券 A

阶段	净值增长率①	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	0.22%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.30%	-0.01%
过去六个月	0.77%	0.03%	1.15%	0.03%	-0.38%	0.00%
过去一年	1.71%	0.03%	1.48%	0.04%	0.23%	-0.01%
过去三年	11.36%	0.11%	5.66%	0.07%	5.70%	0.04%
过去五年	16.69%	0.11%	8.15%	0.07%	8.54%	0.04%
过去七年	24.48%	0.10%	10.36%	0.07%	14.12%	0.03%
过去十年	40.23%	0.10%	9.90%	0.07%	30.33%	0.03%
自基金合同生效起至今	79.06%	0.12%	17.05%	0.08%	62.01%	0.04%

英大纯债债券 C

阶段	净值增长率①	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	0.15%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.37%	-0.01%
过去六个月	0.63%	0.02%	1.15%	0.03%	-0.52%	-0.01%
过去一年	1.41%	0.03%	1.48%	0.04%	-0.07%	-0.01%

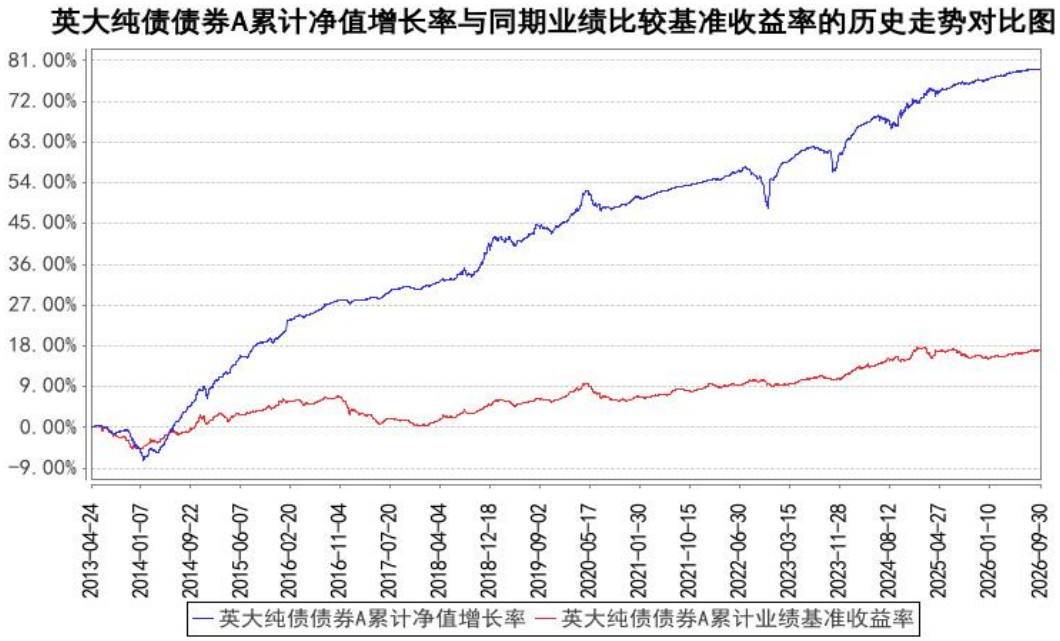
过去三年	10.38%	0.11%	5.66%	0.07%	4.72%	0.04%
过去五年	14.95%	0.11%	8.15%	0.07%	6.80%	0.04%
过去七年	21.90%	0.10%	10.36%	0.07%	11.54%	0.03%
过去十年	35.73%	0.10%	9.90%	0.07%	25.83%	0.03%
自基金合同生效起至今	67.76%	0.11%	17.05%	0.08%	50.71%	0.03%

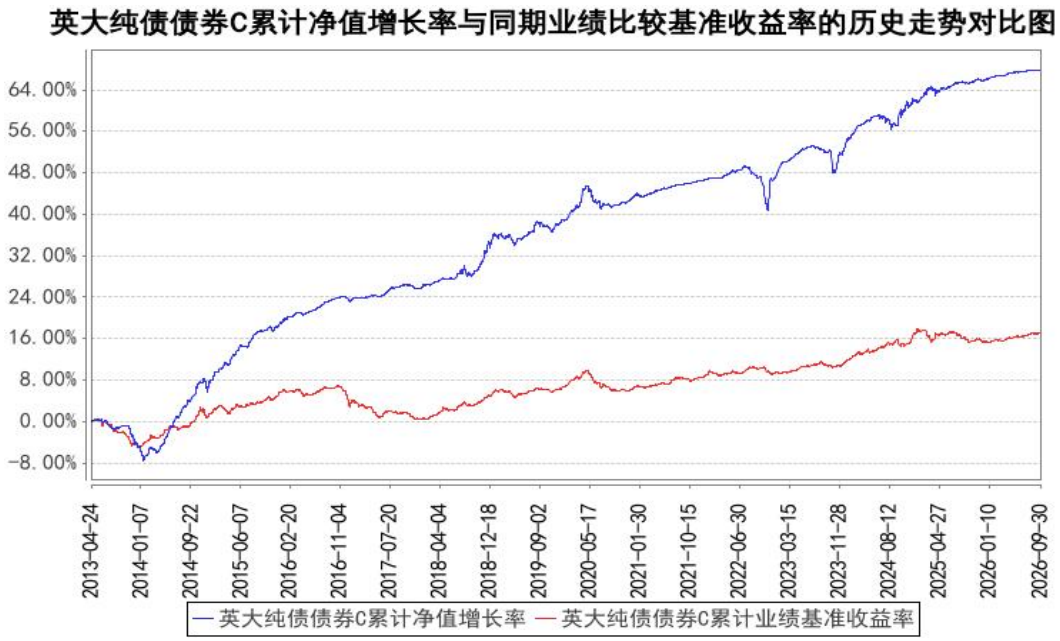
英大纯债债券 E

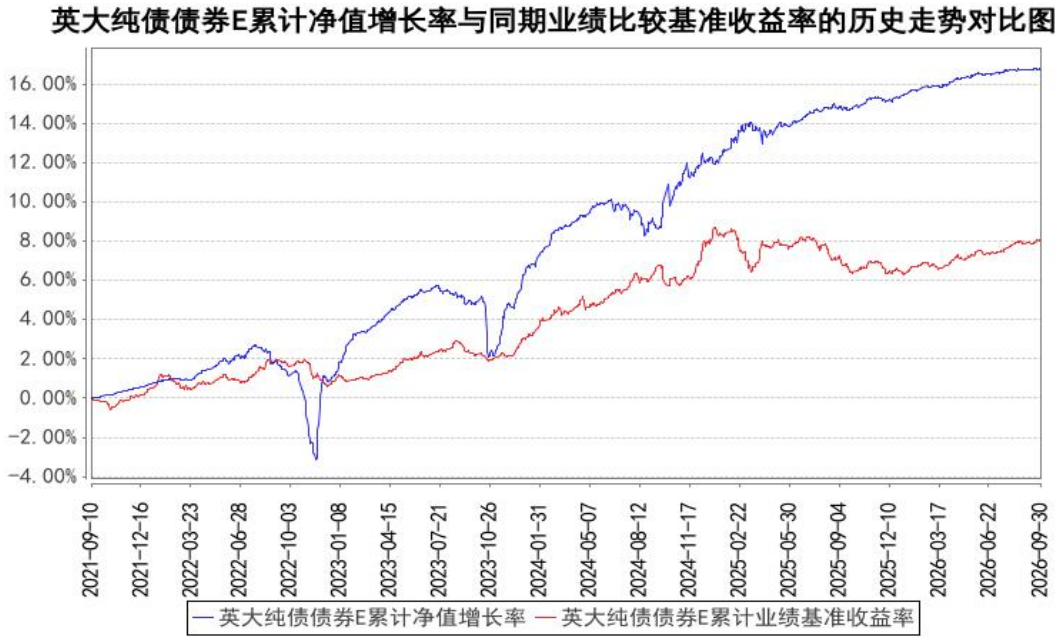
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.22%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.30%	-0.01%
过去六个月	0.78%	0.02%	1.15%	0.03%	-0.37%	-0.01%
过去一年	1.71%	0.03%	1.48%	0.04%	0.23%	-0.01%
过去三年	11.35%	0.11%	5.66%	0.07%	5.69%	0.04%
过去五年	16.68%	0.11%	8.15%	0.07%	8.53%	0.04%
自基金合同生效起至今	16.80%	0.11%	8.00%	0.07%	8.80%	0.04%

注：同期业绩比较基准为中债综合指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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







注：本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张大铮	本基金的	2020 年 1 月 6	-	24 年	硕士学位，研究生学历。历任中银国际证

	基金经理	日			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 月加入英大基金管理有限公司，历任公司总经理助理（投资总监）兼固定收益部总经理、基金经理。现任公司副总经理、基金经理，管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 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金。
张婧珣	本基金的基金经理	2023 年 6 月 12 日	-	12 年	硕士学位，研究生学历。历任寰富投资投资交易部金融衍生品交易员，蓝石资产管理有限公司交易部交易经理，民生基金管理有限公司(筹)研究部研究员。2019 年 10 月加入英大基金管理有限公司，历任公司固定收益部基金经理助理、固定收益部基金经理（拟任）。现任公司固定收益部基金经理，管理英大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、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金、英大智益债券型证券投资基金。

注：1.上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 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

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《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》、《英大纯债债券型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，以取信于市场和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。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，无损

害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、私募资产管理计划等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括：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。所有投资组合共享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、私募资产管理计划等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括：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。

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

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的公平执行，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

报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，国内经济整体延续结构性修复态势，整体延续“外需偏强、内需偏弱、新旧

动能分化”的运行特征。传统产业增速平稳，高技术制造、数字经济等新兴产业持续发力。受益于海外市场需求支撑以及新能源、机电类优势产品的需求增长，外需韧性仍强。内需修复偏弱，居民消费信心修复仍需时间。地产行业仍在磨底，投资增速持续低迷；依托专项债提速发行、财政前置发力，基建投资维持稳健；制造业整体增长动能不足。CPI 小幅温和抬升，PPI 受国际大宗商品价格波动影响存在阶段性震荡。

三季度资金面整体较为平稳，债市收益率整体震荡下行，多空博弈加剧、期限利差持续收窄。7 月，国内基本面偏弱叠加资金面宽松，带动长端利率阶段性下行，月末受利率债供给升温、外盘收益率上行影响，行情震荡反复。8 月上旬债市延续偏强走势，随后收益率低位引发交易盘止盈，叠加美债利率走高，市场整体进入震荡走势。9 月迎来季度利率债供给高峰，政府债券集中发行扰动流动性，虽央行灵活维稳资金面，但内外约束下长端下行空间有限，市场围绕政策与宏观数据博弈维持震荡走势。

报告期内，本基金维持了较为稳健的仓位和久期，配置标的主要为中短久期信用债和利率债，长久期利率债参与波段操作，可转债配置均衡，严控产品的信用风险和流动性风险，保持稳健的投资风格。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末英大纯债债券 A 基金份额净值为 1.1835 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.22%；截至本报告期末英大纯债债券 C 基金份额净值为 1.1673 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.15%；截至本报告期末英大纯债债券 E 基金份额净值为 1.2087 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.22%；业绩比较基准收益率为 0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	968,041,275.12	99.80
	其中：债券	968,041,275.12	99.80

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,975,649.76	0.20
8	其他资产	7,169.17	0.00
9	合计	970,024,094.05	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金于本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金于本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金于本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	15,435,909.44	1.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	396,780,896.42	40.93
	其中：政策性金融债	205,287,027.93	21.17
4	企业债券	45,821,040.54	4.73
5	企业短期融资券	129,513,405.70	13.36
6	中期票据	346,617,115.61	35.75
7	可转债（可交换债）	33,872,907.41	3.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	968,041,275.12	99.85

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	012680937	26 碧水源 SCP002	520,000	52,428,816.22	5.41
2	012680508	26 昆明交投 SCP001	440,000	44,580,093.59	4.60

3	102482363	24 云建投 MTN012	350,000	35,545,386.30	3.67
4	220210	22 国开 10	300,000	32,655,789.04	3.37
5	092118001	21 农发清发 01	300,000	31,517,605.48	3.25

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金于本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金于本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期末无国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金于本报告期内未参与国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金于报告期内未参与国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

经查询，本基金投资的前十名证券的发行主体，除以下情形外，本期未出现其他被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到其他公开谴责、处罚的情形。

26 碧水源 SCP002：碧水源因未按期申报税款多次被国家税务总局北京市密云区税务局太师屯税务所、国家税务总局北京经济技术开发区税务局瀛海税务所和国家税务总局北京市怀柔区税务局龙山税务所责令限期改正。

26 昆明交投 SCP001：2025 年 11 月 19 日，昆明市交通投资集团有限责任公司因未及时就达到临时信息披露标准的债务逾期事项披露临时报告被上海证券交易所债券业务中心书面警示。

22 国开 10：国家开发银行因未按期申报税款多次被国家税务总局北京市怀柔区税务局龙山税务所责令限期改正。

21 农发清发 01：2026 年 7 月 21 日，中国农业发展银行因办理经常项目资金收付未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查、违反规定办理资本项目资金收付、违反规定办理结汇售汇业务、违反外汇账户管理规定被国家外汇管理局北京市分局警告、没收违法所得并罚款。

25 天风证券 CP004：2026 年 3 月 12 日，天风证券股份有限公司因为其股东或者股东的关联人提供融资信息披露违法违规行为被湖北证监局警告并罚款；2026 年 3 月 12 日，天风证券股份有限公司因未及时披露永安林业持股变动信息行为被福建证监局责令改正、警告并罚款；2026 年 3 月 12 日，天风证券股份有限公司因部分员工存在推介非公司代销的金融产品的情形，公司违规与武汉当代天信财富投资管理有限公司协同开展业务，公司违规销售福升安心稳健 1 号固定收益类私募投资基金，公司经营决策不审慎,对子公司及分支机构管控不力,未有效控制风险等问题被湖北证监局暂停相关业务、责令处分相关人员；2026 年 3 月 13 日披露，天风证券股份有限公司因信息披露延迟违规被深圳证券交易所通报批评；2026 年 3 月 13 日，天风证券股份有限公司因在天风证券为其股东或者股东的关联人提供融资，未按规定履行信息披露义务、年度报告存在重大遗漏被上海证券交易所公开谴责。

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,244.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	924.41
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,169.17

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

1	113052	兴业转债	6,224,978.36	0.64
2	110085	通 22 转债	3,721,872.00	0.38
3	113053	隆 22 转债	3,647,466.96	0.38
4	127038	国微转债	2,783,133.56	0.29
5	127049	希望转 2	2,166,555.62	0.22
6	123259	锦浪转 02	1,454,029.86	0.15
7	127083	山路转债	1,209,879.45	0.12
8	127040	国泰转债	1,157,169.86	0.12
9	113049	长汽转债	1,060,153.42	0.11
10	127089	晶澳转债	1,027,769.18	0.11
11	113616	韦尔转债	986,078.22	0.10
12	127110	广核转债	819,201.86	0.08
13	113070	渝水转债	612,861.64	0.06
14	110099	福能转债	578,378.96	0.06
15	127084	柳工转 2	537,992.33	0.06
16	113700	海天转债	506,568.66	0.05
17	113051	节能转债	463,588.49	0.05
18	110097	天润转债	416,324.38	0.04
19	127064	杭氧转债	403,927.81	0.04
20	127082	亚科转债	387,591.78	0.04
21	113062	常银转债	380,386.77	0.04
22	113056	重银转债	375,996.16	0.04
23	127056	中特转债	363,013.48	0.04
24	118034	晶能转债	347,067.53	0.04
25	127113	长高转债	295,360.60	0.03
26	118063	金 05 转债	270,422.74	0.03
27	113691	和邦转债	268,480.82	0.03
28	110098	南药转债	262,470.96	0.03
29	113661	福 22 转债	257,778.08	0.03
30	123149	通裕转债	256,712.71	0.03
31	113677	华懋转债	141,317.95	0.01
32	127112	尚太转债	135,603.10	0.01
33	123262	神宇转债	127,538.88	0.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大纯债债券 A	英大纯债债券 C	英大纯债债券 E
报告期期初基金份额总额	722,437,376.22	19,341,811.93	156,423,982.26
报告期期间基金总申购份额	409,311.33	1,203,173.97	-
减:报告期期间基金总赎回份额	22,124,406.13	4,315,897.10	56,145,055.57
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	700,722,281.42	16,229,088.80	100,278,926.69

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20260701-20260930	370,862,620.74	-	-	370,862,620.74	45.38
	2	20260701-20260930	256,387,488.25	-	-	256,387,488.25	31.37
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准英大纯债债券型证券投资基金设立的文件

《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》

《英大纯债债券型证券投资基金托管协议》

《英大纯债债券型证券投资基金招募说明书》

《英大纯债债券型证券投资基金产品资料概要》

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

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所或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

2026 年 10 月 27 日