

---

英大策略优选混合型证券投资基金  
招募说明书（更新）摘要  
（2016年第2号）

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

### 【重要提示】

本基金于2015年6月23日经中国证监会证监许可[2015]1334号文准予募集注册。

本基金基金合同于2015年12月2日正式生效，自该日起基金管理人开始管理本基金。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金可投资中小企业私募债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书所载内容截止日为2016年12月1日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2016年9月30日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 第一部分 基金管理人

### 一、概况

1、名称：英大基金管理有限公司

2、住所：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、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

4、法定代表人：张传良

5、设立时间：2012 年 8 月 17 日

6、电话：010-57835666

全国统一客服热线：400-890-5288

7、联系人：马若璞

8、注册资本：2 亿元人民币

9、股权结构：英大国际信托有限责任公司、中国交通建设股份有限公司、航天科工财务有限责任公司共同发起设立，并于 2012 年 8 月 17 日获得开业批文，注册资本 2 亿元人民币，三家股东出资比例分别为 49%、36%、15%。

### 二、主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

张传良：董事长，自 2014 年 9 月 18 日起任职，西安交通大学工商管理硕士，高级经济师。现任英大国际信托有限责任公司总经理、党组书记。2000 年 1 月加入英大国际信托有限责任公司，历任证券投资经理、总经理助理、副总经理、监事长、纪委书记、党组成员，其中 2008 年 5 月至 2012 年 4 月期间兼任英大期货有限公司董事。

周丰收：董事，自 2015 年 4 月 15 日起任职，大学学历，高级会计师。现任英大国际信托有限责任公司总会计师、党组成员。历任山东电力试验研究所财务部主管会计，山东电力科学研究院实业总公司总经理助理兼财审部主任，山东电力科学研究院财务部副总会计师兼财务部主任，山东电力研究院（山东电力高等专科学校）财务部主任，山东电力研究院（山东电力高等专科学校）（鲁能科技集团）副总会计师兼产业集团副总经理、深圳易通创业投资有限公司总经理，山东电力研究院（山东电力高等专科学校）（中实易通集团）副总会计师兼产业集团总经理、深圳易通创业投资有限公司总经理，英大国际信托有限责任公司托管部、

---

财务资产部副主任、主任。

王利生：董事，自 2014 年 9 月 18 日起任职，华南理工大学工商管理硕士，高级工程师、高级经济师、国家注册一级建造师。现任中交投资有限公司副总经理。历任中交四航局第三工程公司项目经理、副总经理，中交第四航务工程局有限公司投资事业部总经理。

王小红：董事，自 2015 年 12 月 18 日起任职，海军工程学院管理工程学士学位，高级经济师。现任航天科工财务有限责任公司副总裁。历任三江航天集团红林机械厂人事教育处干事、计划处处长、厂办主任、厂长助理兼财务处处长，三江航天集团财务有限责任公司副总经理、总经理。

杨庆蔚：独立董事，自 2014 年 9 月 18 日起任职，北京师范大学学校教育学士学位，经济师。自 2009 年 12 月正式离开工作岗位，现已退休。历任国家计委科教局教育处干部，国家计委文教局综合处副处长，国家计委社会发展司综合处处长，国家计委社会发展司副司长、国家发展计划委员会社会发展司司长，国家发展改革委员会投资司司长，中国投资有限责任公司副总经理、副首席投资官，中国建银投资有限责任公司董事长，中国投资协会理事。

刘少军：独立董事，自 2014 年 9 月 18 日起任职，中国政法大学经济法学博士。现任中国政法大学金融法研究中心主任、民商经济法学院财税金融法研究所所长，教授、博士生导师。中国法学会银行法学研究会副会长、学术委员会主任。历任山西财经大学财政金融学院（原山西财经学院财政金融系）金融业务教研室副主任、副教授。

尹惠芳：独立董事，自 2014 年 9 月 18 日起任职，专科学历，高级会计师。自 2009 年 3 月正式离开工作岗位，现已退休。历任南京晨光集团有限责任公司财务处会计员、副处长、处长、副总会计师、总会计师、董事及总会计师；航天晨光股份有限公司董事。

## 2、基金管理人监事会成员

李金明：监事会主席，自 2014 年 9 月 18 日起任职，北京大学会计学硕士，高级会计师。现任中交投资有限公司董事、总会计师。历任交通部第一公路工程总公司天津高架桥项目经理部财务科会计员，中国路桥（集团）总公司黄石长江大桥施工指挥部主管会计，中国路桥（集团）总公司卢旺达基加利办事处主管会计，中国路桥（集团）总公司肯尼亚内罗毕办事处财务部经理，中国路桥（集团）总公司财务部分部经理，中国路桥（集团）总公司上市工作办公室项目经理，路桥集团国际建设股份有限公司财务部副经理、经理，中国路桥集团（香港）有限公司财务部经理、财务总监、副总经理兼财务总监，中交公路规划设计院有限公司总会计师、总会计师兼总法律顾问。

---

翟红卫：监事，自 2015 年 4 月 15 日起任职，山东大学工商管理硕士，高级经济师。现任英大国际信托有限责任公司法律与合规管理部主任。历任中国工商银行济南历下支行会计、文秘，济南分行宣教员，济南国际信托投资公司办公室、投资部副科长，英大国际信托有限责任公司投资部、办公室、融资租赁部副经理，资金信托部经理，信托业务部主任，山东业务部副主任兼信托部经理，信托业务总部主任，固有资产管理部主任，董监事会办公室主任。

王兴梅：职工监事，自 2015 年 6 月 16 日起任职。江西财经大学研究生院财务管理硕士，中级审计师，注册会计师。现任英大基金管理有限公司销售服务部总经理兼华北（北京）营销中心营销总监。曾就职于中国证监会北京证监局。

### 3、总经理及其他高级管理人员

张传良先生：代行总经理，自 2016 年 9 月 2 日起任职。工商管理硕士、高级经济师。现任英大国际信托有限责任公司总经理、党组副书记。2000 年 1 月加入英大国际信托有限责任公司，曾任证券投资经理、总经理助理、副总经理、监事长、纪委书记、党组成员，其中 2008 年 5 月至 2012 年 4 月期间兼任英大期货有限公司董事。

赵照先生：副总经理，自 2012 年 12 月 26 日起任职。清华大学工商管理硕士，高级经济师。18 年证券、银行、信托和基金等金融行业工作经验。历任中国电力财务有限公司总经理工作部副主任、法律及合规部主任、发展策划部主任，国家电网公司金融资产管理部发展策划处处长，国网英大国际控股集团有限公司发展策划部主任；中国电力财务有限公司董事，湘财证券有限责任公司董事，中信产业投资基金管理有限公司咨询委员会委员，中广核（二期）产业投资基金有限责任公司咨询委员会委员等职务。

### 4、督察长

宗宽广先生，督察长，自 2016 年 3 月 16 日起任职。中国人民大学经济学博士，中级经济师。曾任广州证券北京西直门外大街营业部交易部主管、华泰证券北京月坛南街营业部客户服务中心经理助理、宏源证券股份有限公司操作风险组组长、中交投资基金管理（北京）有限公司投资二部负责人。

### 5、本基金基金经理

袁忠伟先生，武汉工业大学工程学士，北京工业大学管理工程硕士。2015 年 1 月加入英大基金管理有限公司，现任权益投资部总经理。具备 15 年证券、基金行业从业经历。历任中国民族证券研究发展中心行业公司部经理，证券投资部总经理助理、执行总经理；华西证券股份有限公司资产管理总部投资管理部研究总监、投资主办人；英大基金研究发展部副总经

---

理。

张玮女士，湖南大学软件工程学士，中国社会科学院研究生院工商管理硕士。2012年10月加入英大基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理。具备5年保险、基金从业经历。历任合众资产管理股份有限公司交易员，英大基金管理有限公司交易管理部债券交易员、副总经理。

#### 6、投资决策委员会委员名单

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

主任赵照先生（见公司高级管理人员）。

副主任樊锐先生，总经理助理兼研究发展部负责人。

委员袁忠伟先生，权益投资部总经理。

委员张琳娜女士，固定收益部总经理。

委员张玮女士，固定收益部基金经理。

上述人员之间无近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

---

#### 四、基金管理人承诺

##### 1、基金管理人承诺：

(1) 严格遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及其他法律法规行为的发生；

(2) 根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资。

##### 2、基金管理人严格按照法律、法规、规章的规定，基金资产不得用于下列投资或者活动：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 法律法规以及中国证监会规定禁止的其他行为。

##### 3、基金经理承诺：

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### 五、基金管理人的内部控制制度

##### 1、风险管理理念与目标

(1) 确保合法合规经营；

(2) 防范和化解风险；

(3) 提高经营效率；

(4) 保护投资者和股东的合法权益。

##### 2、风险管理措施

(1) 建立健全公司组织架构；

(2) 树立监察稽核功能的权威性和独立性；

---

(3) 加强内控培训，培养全体员工的风险管理意识和监察文化；

(4) 制定员工行为规范和纪律程序；

(5) 建立岗位分离制度；

(6) 建立危机处理和灾难恢复计划。

### 3、风险管理和内部控制的原则

(1) 全面性原则：公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

(2) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

(3) 相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性；

(5) 防火墙原则：基金财产、公司自有资产、其他资产的运作应当严格分开并独立核算。

### 4、内部控制体系

#### I、内部控制的组织架构

1) 董事会风险管理委员会：负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行检查和评估；对公司监察稽核制度的有效性进行评价；监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准；对公司风险管理制度进行评价，草拟公司风险管理战略，对公司风险管理制度的实施进行检查，评估公司风险管理状况。

2) 风险控制委员会：负责协助总经理控制公司风险的议事机构，在总经理办公会的领导下制定公司风险管理制度和政策，统一领导和协调公司的风控与合规工作，对监察稽核部提交的风险评估报告作出全面的讨论和决定，从而使风险政策得到有力的执行。

3) 投资决策委员会：投资决策委员会是公司投资管理的最高决策机构，由公司总经理、分管投资的副总经理、投资总监、投资部经理、资深基金经理、研究部经理，督察长列席会议。投资决策委员会的主要职责为：制定公司的投资决策程序及权限设置；制定基金的投资原则、投资目标和投资理念；制定基金的资产分配比例，制定并定期调整投资总体方案；审批基金经理提出的行业配置及超过基金经理和投资总监权限的投资品种；审批基金经理的年

---

度投资计划及考核其执行情况；定期检查并调整投资限制性指标。

4) 督察长：督察长坚持原则、独立客观，以保护基金份额持有人利益为根本出发点，公平对待全体投资人。督察长的主要职责为：对公司经营和管理、基金运作遵纪守法、风险控制情况进行内部监控和检查；对公司各项制度的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监控和检查；就以上监控和检查中发现的问题向经营层通报并提出整改和处理意见；定期向董事会提交工作报告；审核监察稽核部的工作报告。

5) 监察稽核部：对公司经营层负责，协助督察长开展工作。监察稽核部在各部门自我监察的基础上依照所规定的职责权限、工作程序进行独立的再监督工作，对公司经营的法律法规风险进行管理和监察，与公司各部门保持相对独立的关系。监察稽核部主要负责对公司制度合法合规性的检查，监督各项制度的落实，对可能发生的违法违规风险进行监控，及时报告，并对发现的问题提出改进意见和建议。

## II、内部控制的原则

公司的内部控制遵循以下原则：

(1) 健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则：公司设立独立的法律、监察稽核部，法律、监察稽核部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

(4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

(5) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

公司制订内部控制制度遵循以下原则：

(1) 合法合规性原则：公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；

(2) 全面性原则：内部控制制度涵盖公司管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

(3) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

(4) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

---

### III、内部风险控制措施

建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系和完善的内部控制制度。公司成立以来，根据中国证监会的要求，建立了科学合理的层次分明的内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修改，公司已初步形成了较为完善的内部控制制度。

建立健全了管理制度和业务规章：公司建立了包括风险管理制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。

建立了岗位分离、相互制衡的内控机制：公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易，交易与清算，公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

建立健全了岗位责任制：公司通过建立健全了岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。

构建风险管理系统：公司通过建立风险评估、预警、报告和控制以及监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。建立自动化监督控制系统：公司启用了电子化投资、交易系统，对投资比例进行限制，将有效地防止合规性运作风险和操作风险。

使用数量化的风险管理手段：采用数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、规避和控制，尽可能减少损失。

提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工具有较高的职业水准，从培养职业化专业理财队伍角度控制职业化问题带来的风险。

#### 5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

成立时间：1988 年 7 月 8 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：154 亿人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》，证监许可[2009]363 号

联系人：周小磊

联系电话：(010) 65169562

广发银行股份有限公司成立于 1988 年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于广东省广州市，注册资本 154 亿元。二十多年来，广发银行栉风沐雨，艰苦创业，以自己不断壮大的发展历程，见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

2016 年 3 月 1 日，中国人寿发布公告，公司与花旗集团及 IBM Credit 签订了相关收购协议，拟以 6.39 元/股的价格，收购后者合计持有的广发银行 36.48 亿股，总对价约为 233.12 亿元。目前，中国人寿持有广发银行约 67.29 亿股，持股比例 43.686%，为广发银行单一最大股东。

截至 2015 年 12 月 31 日，广发银行总资产 18365.87 亿元，较年初增幅 11.44%；总负债 17,390.47 亿元，较年初增幅 11.43%；实现营业收入 547.35 亿元，同比增长 22.61%；拨备前利润 325.55 亿元，同比增长 34.15%。据英国《银行家》杂志 2015 年全球银行排名，本行按一级资本列 92 位，首次进入百强，五年来大幅提高了 126 位。

#### （二）主要人员情况

---

广发银行股份有限公司总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设业务运行处、监控管理处、期货业务处和产品营销处，部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格，部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

部门负责人蒋柯先生，经济学硕士，高级经济师，从事托管工作十七年，托管经验丰富。曾担任大型国有商业银行资产托管部托管业务运作中心副处长、全球资产托管处副处长、全球资产托管处副处长（主持工作）等职务。曾被中国证券业协会聘任为证券投资基金估值工作小组组长。2015年1月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部副总经理，现主持部门工作。

### （三）基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于2009年5月4日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务，基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363号。截至2016年6月末，托管资产规模超19000亿元。建立了一只优秀、专业的托管业务团队，保证了托管服务水准在行业的领先地位。建立了完善的产品线，产品涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、QDII托管、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等，能为托管产品提供全面的托管服务。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

广发银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专设监控管理处，配备了专职内部监察稽核人员，负责托管业务的内部控制和风险管理，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### （三）内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保

---

管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，基金托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

#### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### （二）监督流程

1、每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2、收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3、根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4、通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

### 第三部分 相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### 1、直销机构

名称：英大基金管理有限公司

公司住所：北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

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

邮政编码：100020

法定代表人：张传良

成立时间：2012年8月17日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可【2012】759号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2亿元

存续期间：持续经营

电话：(010) 57835666, 400-890-5288

传真：(010) 59112222

联系人：马若璞

网址：[www.ydamc.com](http://www.ydamc.com)

##### 2、代销机构

###### (1) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

###### (2) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人：闫振杰

---

客服电话：4008188000

公司网站：www.myfund.com

(3) 中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 16 号中期大厦 A 座 8 层

法定代表人：姜新

客服电话：95162 400-8888-160

公司网站：www.cifcofund.com

(4) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

(5) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 楼二层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-181-8188

公司网站：www.1234567.com.cn

本基金将根据业务发展需要及时增加代销机构并进行公告。

## 二、注册登记人

名称：英大基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区环球金融中心西塔 22 楼 2201

法定代表人：张传良

办公地址：北京市朝阳区环球金融中心西塔 22 楼 2201

电话：010-57835666，400-890-5288

传真：010-59112222

---

联系人：马若璞

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市君泽君律师事务所

住所：北京西城区金融大街9号金融街中心南楼6层

负责人：王冰

电话：010-66523388

传真：010-66523399

经办律师：张天民、周淼鑫

### 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：瑞华会计师事务所有限责任公司

办公地址：北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层

法人代表：杨剑涛

电话：(010) 88095588

传真：(010) 88091190

经办注册会计师：张琴、石文余

#### 第四部分 基金的名称

英大策略优选混合型证券投资基金

#### 第五部分 基金的类型

混合型基金

#### 第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。

#### 第七部分 基金的投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合资产配置比例：股票资产占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、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不低于基金资产的 5%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管

---

理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

## 第八部分 基金的投资策略

### 1、大类资产配置策略

本基金首先是进行大类资产配置，尽可能地降低证券市场的系统性风险，把握各类资产的稳健投资机会；其次是采取自下而上的分析方法，从定量和定性两个方面，通过深入的基本面研究分析，精选具有良好投资价值的个股和个债券，构建股票组合和债券组合。

### 2、股票投资策略

在新股投资方面，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用基金管理人的研究平台和股票估值体系，深入发掘新股内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。

本基金二级市场股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手。根据个股的估值水平优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。

#### 1) 定量分析

本基金管理人结合案头分析与实地调研，对列入研究范畴的股票进行全面系统地分析和评价。

#### ①成长能力较强

本基金认为，企业以往的成长性能够在一定程度上反映企业未来的增长潜力，因此，本基金利用主营业务收入增长率、净利润增长率、经营性现金流量增长率指标来考量公司的历史成长性，作为判断公司未来成长性的依据。

主营业务收入增长率是考察公司成长性最重要的指标，主营业务收入的增长所隐含的往往是企业市场份额的扩大，体现公司未来盈利潜力的提高，盈利稳定性的加大，公司未来持续成长能力的提升。本基金主要考察公司最新报告期的主营业务收入与上年同期的比较，并与同行业相比较。

净利润是一个企业经营的最最终成果，是衡量企业经营效益的主要指标，净利润的增长反映的是公司的盈利能力和盈利增长情况。本基金主要考察公司最新报告期的净利润与上年同期的比较，并与同行业相比较。

经营性现金流量反映的是公司的营运能力，体现了公司的偿债能力和抗风险能力。本基

---

金主要考察公司最新报告期的经营性现金流量与上年同期的比较，并与同行业相比较。

### ②盈利质量较高

本基金利用总资产报酬率、净资产收益率、盈利现金比率（经营现金净流量/净利润）指标来考量公司的盈利能力和质量。

总资产报酬率是反映企业资产综合利用效果的核心指标，也是衡量企业总资产盈利能力的重要指标；净资产收益率反映企业利用股东资本盈利的效率，净资产收益率较高且保持增长的公司，能为股东带来较高回报。本基金考察公司过去两年的总资产报酬率和净资产收益率，并与同行业平均水平进行比较。

盈利现金比率，即经营现金净流量与净利润的比值，反映公司本期经营活动产生的现金净流量与净利润之间的比率关系。该比率越大，一般说明公司盈利质量就越高。本基金考察公司过去两年的盈利现金比率，并与同行业平均水平进行比较。

此外，本基金还将关注公司盈利的构成、盈利的主要来源等，全面分析其盈利能力和质量。

### ③未来增长潜力强

公司未来盈利增长的预期决定股票价格的变化。因此，在关注公司历史成长性的同时，本基金尤其关注其未来盈利的增长潜力。本基金将对公司未来一至三年的主营业务收入增长率、净利润增长率进行预测，并对其可能性进行判断。

### ④估值水平合理

本基金将根据公司所处的行业，采用市盈率、市净率等估值指标，对公司股票价值进行动态评估，分析该公司的股价是否处于合理的估值区间，以规避股票价值被过分高估所隐含的投资风险。

## 2) 定性分析

在定量分析的基础上，本基金结合定性分析筛选优质股票，定性分析主要判断公司的业务是否符合经济发展规律、产业政策方向，是否具有较强的竞争力和良好的治理结构。

根据定性分析结果，选择具有以下特征的公司股票重点投资：

- ①符合经济结构调整、产业升级发展方向；
- ②具备一定竞争壁垒的核心竞争力；
- ③具有良好的公司治理结构，规范的内部管理；
- ④具有高效灵活的经营机制。

---

### 3、固定收益品种投资策略

本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。

#### （1）久期策略

根据国内外的宏观经济形势、经济周期、国家的货币政策、汇率政策等经济因素，对未来利率走势做出准确预测，并确定本基金投资组合久期的长短。

考虑到收益率变动对久期的影响，若预期利率将持续下行，则增加信用投资组合的久期；相反，则缩短信用投资组合的久期。组合久期选定之后，要根据各相关经济因素的实时变化，及时调整组合久期。

考虑信用溢价对久期的影响，若经济下行，预期利率将持续下行的同时，长久期产品比短久期产品将面临更多的信用风险，信用溢价要求更高。因此应缩短久期，并尽量配置更多的信用级别较高的产品。

#### （2）期限结构策略

根据国际国内经济形势、国家的货币政策、汇率政策、货币市场的供需关系、

投资者对未来利率的预期等因素，对收益率曲线的变动趋势及变动幅度做出预测，收益率曲线的变动趋势包括：向上平行移动、向下平行移动、曲线趋缓转折、曲线陡峭转折、曲线正蝶式移动、曲线反蝶式移动，并根据变动趋势及变动幅度预测来决定信用投资产品组合的期限结构，然后选择采取相应期限结构策略：子弹策略、杠铃策略或梯式策略。

若预期收益曲线平行移动，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小，宜采用子弹策略，具体的幅度临界点运用测算模型进行测算。若预期收益曲线做趋缓转折，宜采用杠铃策略。若预期收益曲线做陡峭转折，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小宜采用子弹策略；用做判断依据的具体正向及负向变动幅度临界点，需要运用测算模型进行测算。

#### （3）个券选择策略

##### 1) 特定跟踪策略

特定是指某类或某个信用产品具有某种特别的特点，这种特点会造成此类信用产品的价值被高估或者低估。特定跟踪策略，就是要根据特定信用产品的特定特点，进行跟踪和选择。在所有的信用产品中，寻找在持有期内级别上调可能性比较大的产品，并进行配置；对在持有期内级别下调可能性比较大的产品，要进行规避。判断的基础就是对信用产品进行持续内部跟踪评级及对信用评级要素进行持续跟踪与判断，简单的做法就是跟踪特定事件：国家特

---

定政策及特定事件变动态势、行业特定政策及特定事件变动态势、公司特定事件变动态势，并对特定政策及事件对于信用产品的级别变化影响程度进行评估，从而决定对于特定信用产品的取舍。

## 2) 相对价值策略

本策略的宗旨是要找到价值被低估的信用产品。属于同一个行业、类属同一个信用级别且具有相近期限的不同债券，由于息票因素、流动性因素及其他因素的影响程度不同，可能具有不同的收益水平和收益变动趋势，对同类债券的利差收益进行分析，找到影响利差的因素，并对利差水平的未来走势做出判断，找到价值被低估的个券，进而相应地进行债券置换。本策略实际上是某种形式上的债券互换，也是寻求相对价值的一种投资选择策略。

这种投资策略的一个切实可行的操作方法是：在一级市场上，寻找并配置在同等行业、同等期限、同等信用级别下拥有较高票面利率的信用产品；在二级市场上，寻找并配置同等行业、同等信用级别、同等票面利率下具有较低二级市场信用溢价（价值低估）的信用产品并进行配置。

## 4、股指期货投资策略

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

### 1) 套保时机选择策略

根据本基金对经济周期运行不同阶段的预测和对市场情绪、估值指标的跟踪分析，决定是否对投资组合进行套期保值以及套期保值的现货标的及其比例。

### 2) 期货合约选择和头寸选择策略

在套期保值的现货标的确认之后，根据期货合约的基差水平、流动性等因素选择合适的期货合约；运用多种量化模型计算套期保值所需的期货合约头寸；对套期保值的现货标的 Ceta 值进行动态的跟踪，动态的调整套期保值的期货头寸。

### 3) 展期策略

当套期保值的时间较长时，需要对期货合约进行展期。理论上，不同交割时间的期货合约价差是一个确定值；现实中，价差是不断波动的。本基金将动态的跟踪不同交割时间的期货合约的价差，选择合适的交易时机进行展仓。

### 4) 保证金管理

本基金将根据套期保值的时间、现货标的的波动性动态地计算所需的结算准备金，避免

---

因保证金不足被迫平仓导致的套保失败。

#### 5) 流动性管理策略

利用股指期货的现货替代功能和其金融衍生品交易成本低廉的特点，可以作为管理现货流动性风险的工具，降低现货市场流动性不足导致的交易成本过高的风险。在基金建仓期或面临大规模赎回时，大规模的股票现货买进或卖出交易会造成市场的剧烈动荡产生较大的冲击成本，此时基金管理人将考虑运用股指期货来化解冲击成本的风险。

基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

#### 5、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：1 年期银行定期存款利率（税后）+2%

其中，1 年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构 1 年期人民币存款基准利率。

未来，如中国人民银行调整或停止发布基准利率，或市场有其他更适合本基金的基准时，本基金管理人可根据具体情况，与基金托管人协商一致后，对业绩比较基准进行相应调整并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

## 第十一部分 基金的投资组合报告

本投资组合的报告期为 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止（财务数据未经审计）。

### 1、报告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	30,379.07	0.31
	其中：股票	30,379.07	0.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	7,000,130.50	72.27
	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	2,566,954.41	26.50
8	其他资产	88,720.87	0.92
9	合计	9,686,184.85	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,379.07	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	30,379.07	0.36

## 3、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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净
----	------	------	--------	------	--------

					值比例（%）
1	002815	崇达技术	1,372	22,377.32	0.27
2	300548	博创科技	681	8,001.75	0.10

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 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。

#### 11 投资组合报告附注

**11.1** 本期内未发现本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、批评的情况。

**11.2** 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。

##### 11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	66,624.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,873.41
5	应收申购款	5,223.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,720.87

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002815	崇达技术	22,377.32	0.27	新股锁定
2	300548	博创科技	8,001.75	0.10	新股锁定

## 第十二部分 基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。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。

本基金合同生效日为 2015 年 12 月 2 日，基金合同生效以来（截至 2016 年 9 月 30 日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

英大策略优选混合 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
2015.12.2-2015.12.31	2.00%	0.32%	0.28%	0.01%	1.72%	0.31%
2016.1.1-2016.6.30	1.57%	0.21%	1.74%	0.01%	-0.17%	0.20%
2016.7.1-2016.9.30	3.32%	0.22%	0.86%	0.01%	2.46%	0.21%
自基金合同生效日起至 今（2015.12.2-2016.9.30）	7.04%	0.26%	2.90%	0.01%	4.14%	0.25%

英大策略优选混合 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
2015.12.2-2015.12.31	1.90%	0.31%	0.28%	0.01%	1.62%	0.30%
2016.1.1-2016.6.30	0.29%	0.19%	1.74%	0.01%	-1.45%	0.18%
2016.7.1-2016.9.30	-5.00%	0.66%	0.86%	0.01%	-5.86%	0.65%
自基金合同生效日起至 今（2015.12.2-2016.9.30）	-2.91%	0.41%	2.90%	0.01%	-5.81%	0.40%

---

## 第十三部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发

---

送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

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 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

销售服务费使用范围不包括基金募集期间的上述费用。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式等事项请参考本招募说明书第六部分相关内容。本基金申购费、赎回费、转换费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式等事项请参考本招募说明书第八部分相关内容。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

---

#### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费和基金销售服务费率等相关费率。

调低基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率等费率，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前 2 个工作日在至少一种指定媒介上公告。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，我公司结合英大策略优选混合型证券投资基金的运行情况，对其原招募说明书进行了更新，主要更新的内容说明如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了有关信息。
- 2、在“第三部分 基金管理人”部分，更新了相关信息。
- 3、在“第四部分 基金托管人”部分，更新了相关信息。
- 4、在“第五部分 相关服务机构”部分，更新了相关信息。
- 5、在“第八部分 基金份额的申购、赎回与转换”部分，更新了相关信息。
- 6、在“第九部分 基金的投资”部分，更新了截至 2016 年 9 月 30 日的基金投资组合报告。
- 7、在“第十部分 基金的业绩”部分，更新了截至 2016 年 9 月 30 日的基金业绩。
- 8、在“第十二部分 基金资产的估值”部分，更新了相关信息。
- 9、在“第二十部分 基金托管协议的内容摘要”部分，更新了相关信息。
- 10、根据最新公告，对“第二十二部分 其他应披露事项”内容进行了更新。