

华融基金管理有限公司

关于旗下证券投资基金投资资产支持证券的公告

根据中国证监会《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》(证监基金字[2006]93号)及华融基金管理有限公司(以下简称“本公司”)所管理基金的基金合同规定,本公司旗下证券投资基金可以投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券。现将本公司旗下证券投资基金投资资产支持证券的投资方案及相关事宜公告如下:

一、适用范围

本公司旗下所有可投资于资产支持证券的证券投资基金,包括本公告公布后成立的可投资于资产支持证券的证券投资基金。

二、投资策略

本公司旗下的基金投资资产支持证券将严格遵守法律法规和基金合同规定,将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券面临的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、法律风险、操作风险等进行分析,综合运用包括久期策略、信用利差曲线策略、收益率曲线策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。

三、投资限制

本公司旗下证券投资基金投资于资产支持证券,除了遵守基金合同中已有的投资限制条件外,还将遵守下述有关资产支持证券投资的限制条件:

1. 单只证券投资基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%。

2. 单只证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的 10%。

3. 本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

4. 单只证券投资基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的 20%,中国证监会规定的特殊品种除外。

5. 货币市场证券投资基金可投资于剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券。债券基金、股票基金、混合基金等其他类别的基金投资于资产支持证券的期限,依照中国证监会的相关规定和基金合同中的约定执行。浮动利率资产支持证券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。

6. 单只开放式基金(货币市场基金除外)主动投资于流动性受限资产(包含资产支持证券)的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

7. 单只货币市场基金主动投资于流动性受限资产（包含资产支持证券）的市值合计不得超过该基金资产净值的 10%。

8. 因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使证券投资基金投资资产支持证券不符合第 2 条和第 4 条规定比例的, 本公司应当在 10 个交易日内调整完毕。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合第 6、7 项规定的比例, 投资组合经理不得主动新增流动性受限资产的投资。

9. 证券投资基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。货币市场证券投资基金投资的资产支持证券的信用评级, 应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。其他类别的证券投资基金投资于资产支持证券, 根据基金合同制订相应的证券信用级别限制, 若基金合同未订明相应的证券信用级别限制, 应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。证券投资基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

四、风险控制措施

鉴于资产支持证券可能面临的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、法律风险和操作风险, 本公司建立了严格的投资管理制度, 通过内部信用评级等方法对资产

支持证券投资进行有效风险评估及控制。本公司将对资产支持证券投资进行全程合规监控，通过事前控制、事中监督和事后检查等途径，确保资产支持证券投资的合法合规。

五、信息披露方式

本公司将依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》、本公司旗下基金的基金合同、招募说明书及其他有关规定的要求，在本公司旗下有关基金法定信息披露文件中及时、充分地披露旗下有关基金投资资产支持证券的相关信息。

本公司将在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细，在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

六、相关提示

本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，敬请投资人注意投资风险。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书、基金产品资料概要等法律文件，

了解所投资基金的风险收益特征，并根据自身情况购买与风险承受能力相匹配的产品。

特此公告。

华融基金管理有限公司

2020 年 9 月 22 日