

浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下 基金投资资产支持证券方案的公告

根据《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》、中国证监会证监基金字[2006]93号《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》及相关基金合同等规定，现将浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“本公司”或“本基金管理人”)旗下证券投资基金的资产支持证券投资方案和风险控制措施公告如下：

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

本公司旗下基金投资于资产支持证券，将在国内资产证券化品种具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整收益高的品种进行投资，同时将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散，以降低流动性风险。

三、投资限制

本公司旗下证券投资基金投资于全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券，除了遵守基金合同

中已有的投资限制外，还将遵守下述有关资产支持证券的投资限制：

1、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%；

2、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；

3、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%；

4、本基金管理人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%；

5、本基金管理人管理的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。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；

6、因市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资资产支持证券不符合上述

规定的投资比例的，本基金管理人将在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外；

7、若法律法规对证券投资基金投资资产支持证券的投资组合比例限制进行变更的，本基金管理人对旗下证券投资基金投资资产支持证券的投资限制将随之调整。

四、风险控制措施

鉴于投资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、操作风险和法律风险等，本基金管理人建立了严格的投资管理制度，通过内部信用评级、投资授权控制等方法对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制。同时，本基金管理人将对资产支持证券投资进行全程合规监控，通过事前控制、事中监督和事后报告检查等方式，确保资产支持证券投资的合法合规。

五、信息披露方式

本基金管理人将在基金年报及半年报中披露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、风险揭示

本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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未

来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩亦不构成对本基金业绩表现的保证。投资者投资本公司管理的各基金时，应认真阅读各基金的基金合同、招募说明书及其更新和上述资产支持证券投资方案及风险控制措施。

特此公告。

浙江浙商证券资产管理有限公司

2016年11月18日