

财通基金管理有限公司关于旗下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)及基金合同的规定,财通基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下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、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,将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用数量化定价模型,评估其内在价值。

二、投资限制

本公司旗下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比例限制外,还将遵守下述有关资产支持证券投资比例的限制:

- 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、 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。

6、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。

7、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。

三、风险控制措施

针对投资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、法律风险和操作风险等风险,本公司建立了严格的投资及风险管理制度,通过内部信用评级、投资分级授信控制、投资交易监控系统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、事中监督和事后报告检查等方式,确保资产支持证券投资的合法合规。

四、信息披露方式

本公司将依照《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半年报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。

风险提示: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。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告。

财通基金管理有限公司

二〇一七年三月四日