

东吴基金管理有限公司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）、相关法律法规的要求及东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）所管理基金的基金合同，本公司旗下基金可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，现将本公司管理的证券投资基金投资资产支持证券的投资方案及相关事项公告如下：

一、投资策略

本公司旗下基金投资资产支持证券将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券 α 策略等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。本公司旗下基金将本着风险收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，以期获得长期稳定收益。

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：

（一）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上述第2条和第4条规定比例的，本公司将在10个交易日内调整完毕。

6、货币市场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。

（二）信用等级的限制

1、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。

2、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，应遵守基金合同规定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。

3、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

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、投资授信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。

四、信息披露方式

本基金管理人将依照《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。

本基金管理人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。

五、风险揭示

资产支持证券虽然是国际上一种成熟的证券产品,但在国内市场发展初期可能具有低流动性、高收益的特征,并存在一定的投资风险。本基金管理人所管理的部分证券投资基金将投资资产支持证券,请基金份额持有人注意投资风险。本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资产,并将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者申购本基金管理人旗下基金时,应认真阅读相关基金合同、基金招募说明书和本投资方案。

投资者可通过本基金管理人的网站: www.scfund.com.cn 或客户服务电话: 400-821-0588 了解详情。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2018年6月11日