

海富通基金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》的要求及基金合同的约定，海富通基金管理有限公司(以下简称“本公司”)管理的海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金、海富通中小盘股票型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)(场内简称：海富增利)、海富通国策导向股票型证券投资基金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通双利分级债券型证券投资基金、海富通内需热点股票型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福分级债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金(场内简称：城投ETF)、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金以及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，可以投资于在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。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》、基金合同、招募说明书及相关法律法规的规定，本公司特制定上述证券投资基金投资资产支持证券的方案并公告如下：

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调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。

二、投资比例限制

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、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%。

4、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%。

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 3 条规定比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。

5、海富通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。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。其他证券投资基金投资于资产支持证券的剩余期限,依照证监会的相关规定和基金合同的约定执行。

6、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。海富通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。除海富通货币市场证券投资基金以外的其他证券投资基金投资的资产支持证券的信用评级应为 BBB 以上。

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。

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。

特此公告。

海富通基金管理有限公司

2015年3月5日