

东方基金管理有限责任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）及相关基金合同的规定，东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）管理的公开募集证券投资基金（以下简称“基金”或“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。现将本公司管理基金投资资产支持证券的投资方案及有关事项公告如下：

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久期管理、信用资质分析等进行资产支持证券投资组合管理，并根据信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、法律风险、操作风险等变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以获得长期稳定收益。

二、 投资限制

（一） 投资比例与期限限制

本公司管理基金投资于资产支持证券，除了遵守各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投资比例与期限的限制：

1. 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%。
2. 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%。
3. 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%。
4. 单只货币市场基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%。单只债券基金、股票基金、混合基金等其他类别的基金所持有全部资产支持证券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. 有关法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。因市场波动、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条款规定的比例，本公司应当在 10 个交易日内调整完毕。
6. 本公司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。

封闭型债券基金、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不得超过该基金封闭期剩余期限+1年，并依照中国证监会的相关规定和基金合同中的约定执行。

（二）信用评级限制

1. 基金投资的资产支持证券须由具有评级资质的资信评级机构进行信用评级，公司原则上只接受取得中国人民银行、国家发展和改革委员会、中国证券监督管理委员会、中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会证券评级认可的评级机构出具的资信评级。
2. 公司货币市场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评级限制，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. 基金持有资产支持证券期间，如果其信用评级下降、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

1. 本公司将紧密关注利率政策、货币政策、国内信用评级机构对所投资资产支持证券的跟踪评级，对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制。
2. 以非信贷类资产作为基础资产的资产支持证券，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超过该资产支持证券的3%，需进行现场调查。
3. 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》和基金合同及其它有关规定的要求，在基金法定信息披露文件中及时、充分地披露该基金投资资产支持证券的相关信息。

本公司依法披露所管理的证券投资基金投资资产支持证券及投资方案的情况，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本公司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所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、 相关提示

本公司承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不对投资人保证基金一定盈利，也不向投资人保证最低收益。投资者投资本公司旗下各基金时，应认真阅读各基金的基金合同、招募说明书和上述资产支持证券投资方案和风险控制措施。

特此公告。

东方基金管理有限责任公司

2015 年 10 月 19 日