

广发证券资产管理（广东）有限公司

关于旗下集合资产管理计划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）等相关法律法规及广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“本公司”或“管理人”）所管理的已参照公开募集证券投资基金完成变更的集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“大集合产品”）的集合合同和招募说明书的规定，本公司旗下集合计划及未来本公司参照公开募集证券投资基金完成变更的其他集合计划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。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》、集合合同、招募说明书及相关法律法规的规定，现将本公司旗下集合计划投资资产支持证券的投资方案及有关事项公告如下：

一、适用范围

根据集合计划资产管理合同的约定，本公司旗下所有可投资于资产支持证券的参照公开募集证券投资基金完成变更的集合资产管理计划，包括本公告公布后参照公开募集证券投资基金完成变更的可投资于资产支持证券的集合资产管理计划。

二、投资策略

本公司旗下集合计划投资资产支持证券将严格遵守法律法规和集合合同规定，资产支持证券的投资将采用自下而上的方法，结合信用管理和流动性管理，重点考察资产支持证券的资产池现金流变化、信用风险情况、市场流动性等，采用量化方法对资产支持证券的价值进行评估，精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。

三、投资限制

本公司旗下集合计划投资资产支持证券，除了遵守各集合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：

（一）投资比例限

1、单只集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的10%；

2、单只集合计划持有的同一（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、本公司管理的全部基金及大集合产品投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过公司各类资产支持证券合计规模的 10%；

4、单只集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的 20%；

5、因市场波动、上市公司合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资资产支持证券不符合上述第 1 条和第 4 条规定比例的，管理人应当在 10 个交易日内调整完毕，但中国证监会规定的特殊情形除外；

6、集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。集合计划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。

四、资产支持证券投资风险提示

尽管管理人本着谨慎和风险可控的原则进行资产支持证券投资，但仍面临以下风险：

1、信用风险

集合计划所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成集合计划财产损失。

2、利率风险

市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，集合计划持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

3、流动性风险

受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，可能无法在合理的时间内以公允价格卖出较大数量的资产支持证券，存在一定的流动性风险。

4、提前偿付风险

债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使集合计划资产面临再投资风险。

5、操作风险

在资产支持证券的投资过程中由于未能按照既有的操作流程进行操作或操作失误未能达到预期投资目标而形成的风险。

6、法律风险

在资产支持证券的投资运作过程中，由于违反投资限制、信息披露的相关法律法规的规定或产品合同的约定，导致公司利益受损或受到监管处罚的风险。

五、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，本公司建立了相应的风险评估流程，并制订相应的投资审批程序和风险控制制度，通过信用分析、投资比例限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。

六、信息披露方式

本公司依照《公开募集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》和集合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、充分地披露该集合计划投资资产支持证券的相关信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本公司将在集合计划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集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细，将在集合计划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集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划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集合计划资产, 但不保证集合计划一定盈利, 也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于集合计划前应认真阅读集合计划的集合合同、更新的招募说明书。

特此公告。

广发证券资产管理（广东）有限公司

2020 年 11 月 18 日