

## 华泰证券（上海）资产管理有限公司

### 关于资产支持证券投资方案和风险控制措施的公告

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）的规定和华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“本公司”）所管理基金的基金合同，本公司旗下证券投资基金及未来本公司发行的其他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。根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同、招募说明书及相关法律法规的规定，特制定本公司旗下基金资产支持证券投资方案和风险控制措施并公告如下：

#### 一、适用范围

本公司旗下所有可投资于资产支持证券的证券投资基金，包括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。

#### 二、投资策略

本公司旗下基金在严格遵守法律法规和基金合同的基础上，根据利率风险、信用风险、流动性风险、违约风险等变化，在对资产支持证券的基础资产质量、发行条款、提前偿付风险等进行仔细研究和比较之后，选择风险收益调整后相对价值较高的资产支持证券进行投资，并综合运用久期管理、行业及地域分析、信用评级支持等策略进行组合管理。同时将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低组合流动性风险。

#### 三、投资限制

本公司管理基金投资资产支持证券，除了遵守基金合同中已有的投资限制之外，还将遵守下述有关资产支持证券投资比例、信用评级及期限的限制规定：

- 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、公司所管理的全部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、单只货币市场基金投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%。

6、单只货币市场基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。

7、单只开放式基金（货币市场基金除外）主动投资于流动性受限资产（包含资产支持证券）的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

8、单只货币市场基金主动投资于流动性受限资产（包含资产支持证券）的市值合计不得超过该基金资产净值的 10%。

因市场波动、证券发行人合并、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（1）-（6）项规定的比例，投资组合经理应当在 10 交易日内调整完毕；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合第（7）、（8）项规定的比例，投资组合经理不得主动新增流动性受限资产的投资。

9、货币市场基金应当投资于剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券。除货币市场基金以外的公司管理的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。

10、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。

11、证券投资基金投资的资产支持证券必须在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易。

12、法律法规或基金合同对本公司旗下基金投资资产支持证券的投资限制有特殊规定的，以法律法规或该基金基金合同的特殊规定为准。

#### **四、风险控制措施**

本公司将在充分考量各基金组合投资风格和流动性特点的基础上，通过内部信用评估、投资授信控制、投资交易监控等方法，防范资产支持证券投资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。

同时，本公司将建立覆盖投资全过程的事前、事中和事后控制措施，确保资产支持证券投资的合法合规。

#### **五、信息披露**

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。

#### **六、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。

投资人可通过本公司的网站：<https://htamc.htsc.com.cn/> 或客户服务电话：4008895597 了解详情

特此公告