

华福基金管理有限责任公司关于旗下证券投资基金投资资产支持证券的公告

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, 华福基金管理有限责任公司(以下简称“本公司”)管理的华福货币市场基金以及本公告生效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、投资方案

本公司在确保与基金投资目标相一致的前提下, 本着科学性、谨慎性原则投资资产支持证券, 综合运用各种积极投资策略, 在严格控制风险的情况下, 追求长期稳定收益。

二、风险控制措施

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、本公司以上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、华福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的资产支持证券的信用评级应遵守基金合同的相关约定,如无特别约定的,所投资的资产支持证券的信用评级应为 BBB 级以上(含 BBB)。

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、投资策略

本公司旗下基金投资资产支持证券将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同,在保证本金绝对安全和基金资产流动性基础上获得长期稳定收益。

四、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,本基金管理人将通过内部信用评级、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。

五、信息披露

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》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、充分地披露本基金投资资产支持证券的相关信息。

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,但不向投资人保证基金一定盈利,也不向投资人保

证最低收益。投资者申购本基金时,应认真阅读本基金招募说明书和本投资方案。

特此公告

华福基金管理有限责任公司

2014 年 10 月 27 日