

易方达生物科技指数分级证券投资基金B类份额交易价格波动提示公告

近期,易方达基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下易方达生物科技指数分级证券投资基金B类份额(场内简称:生物B,场内代码:150258B)二级市场交易价格波动较大。2018年8月28日,易方达生物科技分级B类份额在二级市场的收盘价为1.179元,相对于当日E0.9406元的基金份额参考净值,溢价幅度达到25.35%。截止2018年8月29日,易方达生物科技分级B类份额在二级市场的收盘价为1.296元,明显高于基金份额参考净值,投资者如果盲目投资于高溢价率的分级基金,可能遭受重大损失。

为此,本基金管理人提示如下:
1、根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《资管新规》)要求,公募产品不得进行份额分级,存量分级基金须在《资管新规》规定的过渡期结束前进行整改规范,请投资者关注相关风险,如溢价买入可能造成较大损失等。
2、易方达生物科技分级B类份额表现为高风险、高收益的特征。由于易方达生物科技分级份额内含杠杆机制的设计,易方达生物科技分级B类份额参考净值的变动幅度将大于易方达生物科技分级份额(场内简称:生物A,场内代码:161122)净值和易方达生物科技分级A类份额(场内简称:生物A,场内代码:150257)参考净值的变动幅度,即易方达生物科技分级B类份额的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。易方达生物科技分级B类份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

3、易方达生物科技分级B类份额除了份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资者面临损失。
4、截至本公告披露日,易方达生物科技指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日,易方达生物科技指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。
6、风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。销售机构根据法律法规要求对投资者类别、风险承受能力及基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及相关销售机构适当性意见的基础上,根据自身风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择适合的基金产品。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。
敬请投资者注意投资风险。

易方达基金管理有限公司
2018年8月30日

易方达国企改革指数分级证券投资基金B类份额交易价格波动提示公告

近期,易方达基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下易方达国企改革指数分级证券投资基金B类份额(场内简称:国企改革B,场内代码:502008B)二级市场交易价格波动较大。2018年8月28日,易方达国企改革分级B类份额在二级市场的收盘价为0.900元,相对于当日E0.8458元的基金份额参考净值,溢价幅度为6.41%。截止2018年8月29日,易方达国企改革分级B类份额在二级市场的收盘价为0.893元,明显高于基金份额参考净值,投资者如果盲目投资于高溢价率的分级基金,可能遭受重大损失。

为此,本基金管理人提示如下:
1、根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《资管新规》)要求,公募产品不得进行份额分级,存量分级基金须在《资管新规》规定的过渡期结束前进行整改规范,请投资者关注相关风险,如溢价买入可能造成较大损失等。
2、易方达国企改革分级B类份额表现为高风险、高收益的特征。由于易方达国企改革

国金基金管理有限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)的规定和国金基金管理有限公司(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》、《证券投资基金投资资产支持证券办法》、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、利差定价管理等策略,在严格遵循法律法规和基金合同基础上,进行资产支持证券的投资。本基金将根据市场风险调整后收益最大化的原则,注重信用风险和流动性管理,确定资产支持证券品种的合理配置比例,以期获得长期稳定收益。

二、投资限制
本公司上述基金投资资产支持证券除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的限制规定:
(一) 投资比例限制
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、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、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不得超过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AA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、同业存款、相关机构发行的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。
7、所投资的资产支持证券的原始权益人无主体信用评级,则低于AA处理。

7、货币市场基金应当投资于剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券。除投资于上述机构发行的其他基金可根据合同的投资于各种剩余期限的资产支持证券。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天数计算。
8、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%。
9、单只货币市场基金主动投资于流动性受限资产的(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以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个工作日内调整符合;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以外的因素致使基金不符合第(8)、(9)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。

三、评级要求
1、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。
2、货币市场基金投资的资产支持证券的信用评级(指债项评级,下同),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。
3、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,若基金合同未对明确的证券信用级别限制,应投资于信用评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。

4、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。

四、证券投资决策
1、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市场或证券交易所交易。
2、法律法规和基金合同对证券投资基金投资资产支持证券比例限制另有规定的,从其规定。
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,上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金不符合第(8)、(9)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。

四、信息披露
1、本次诉讼事项受理基本情况
案由:买卖合同纠纷
一审法院:贵州省高级人民法院
二审法院:中华人民共和国最高人民法院
一审被告(二审上诉人):益福国际贸易股份有限公司
一审被告(二审上诉人):北海新力进出口贸易有限公司
一审被告(二审上诉人):北海泛北商贸有限公司
一审被告(二审被上诉人):北海新力进出口贸易有限公司
一审受理时间:2016年9月11日
二审受理时间:2017年7月17日
一审开庭时间:2016年9月29日、10月18日、10月21日进行了三次开庭审理
二审开庭时间:2017年9月4日
一审判决送达时间:2017年1月17日
二审判决送达时间:2018年8月27日。
二、本次诉讼事项的基本情况
(一)一审原告益福国际的诉讼请求
1.要求被告新力公司、泛北公司及公司共同连带向原告益福国际支付欠款12,193.13万元,并连带支付赔偿责任(金额折算为3,136.24万元,直至被告付清欠款之日止);
2.律师代理费883,968.48元、公证费68,000元由被告承担;
3.诉讼费由被告承担。
(二)诉被告新力公司、泛北公司及益福国际签订了《贸易合作框架协议》,约定双方合作开展贸易业务,进口代理业务,其中贸易业务的操作方式为:益福国际与新力公司、泛北公司指定的第三方公司签订采购合同,同时新力公司、泛北公司与益福国际签订背靠背销售合同,新力公司、泛北公司支付总货款20%的保证金给益福国际,并督促上家交付给益福国际,益福国际支付全部货款给上家,新力公司、泛北公司在约定的2个月或3个月付清剩余80%货款给益福国际,益福国际收益为其垫付资金总额的10%年化率,体现在销售清单中。2014年6月至2014年11月期间,益福国际与广西威远国际贸易有限公司(以下简称“威远公司”),黑龙江益福金泰农业发展有限公司(以下简称“金泰公司”)共11份购销合同,约定益福国际向威远公司、金泰公司购入玉米、麸皮、精提、硅锰合金、锌矿粉等货物,同时,益福国际与新力公司、泛北公司签订了对应的11份购销合同,在合同履行过程中,新力公司、泛北公司共其中4笔贸易业务中益福国际未向新力公司、泛北公司交付货物,新力公司、泛北公司未向益福国际支付上述4笔业务的货款约1.18亿元,遂发生合同纠纷。

分级B类份额内含杠杆机制的设计,易方达国企改革分级B类份额参考净值的变动幅度将大于易方达国企改革分级份额(场内简称:国企改革B,场内代码:502008)净值和易方达国企改革分级A类份额(场内简称:国企改革A,场内代码:502007)参考净值的变动幅度,即易方达国企改革分级B类份额的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。易方达国企改革分级B类份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

3、易方达国企改革分级A类份额的交易价格,除了有份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资者面临损失。
4、截至本公告披露日,易方达国企改革指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日,易方达国企改革指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。
6、风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。销售机构根据法律法规要求对投资者类别、风险承受能力及基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及相关销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择适合的基金产品。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。
敬请投资者注意投资风险。

特此公告。
易方达基金管理有限公司
2018年8月30日

易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告

近期,易方达基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金(场内简称:ZZ500ETF;交易代码:515080,以下简称“本基金”)二级市场交易价格连续波动,2018年8月28日,本基金二级市场收盘价为5.160元,相对于当日4.9344元的基金份额参考净值,溢价幅度为4.57%。截止2018年8月29日,本基金二级市场收盘价为5.150元,明显高于基金份额参考净值,投资者如果盲目投资于高溢价率的基金,可能遭受重大损失。

为此,本基金管理人提示如下:
1、本基金基金合同生效日为2015年8月27日,并于2015年9月14日开始在上海证券交易所上市交易,投资者可通过上海证券交易所买卖基金份额。
2、本基金二级市场的交易价格,除了有份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资者面临损失。
3、截至本公告披露日,本基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

4、截至本公告披露日,本基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。
5、风险提示:基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。销售机构根据法律法规要求对投资者类别、风险承受能力及基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及相关销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择适合的基金产品。
敬请投资者注意投资风险。

特此公告。
易方达基金管理有限公司
2018年8月30日

国金基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告

一、根据国金基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与联讯证券股份有限公司(以下简称“联讯证券”)签署的基金销售服务协议,自2018年8月31日起,投资者可在联讯证券办理下列基金的开户、申购、赎回、定期定额投资和基金转换等业务。
二〇一八年八月三十日

本公司将依照《证券投资基金信息披露管理办法》、产品合同及相关法律法规的要求,及时、充分披露旗下投资资产支持证券的相关信息。
本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不投资人保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者申购或认购本公司基金时,应认真阅读相关基金基金合同、招募说明书,上述资产支持证券投资方案和风险控制措施。

特此公告。
国金基金管理有限公司
2018年8月30日

国金基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告

一、根据国金基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与联讯证券股份有限公司(以下简称“联讯证券”)签署的基金销售服务协议,自2018年8月31日起,投资者可在联讯证券办理下列基金的开户、申购、赎回、定期定额投资和基金转换等业务。
二〇一八年八月三十日

本公司将依照《证券投资基金信息披露管理办法》、产品合同及相关法律法规的要求,及时、充分披露旗下投资资产支持证券的相关信息。
本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不投资人保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者申购或认购本公司基金时,应认真阅读相关基金基金合同、招募说明书,上述资产支持证券投资方案和风险控制措施。

特此公告。
国金基金管理有限公司
2018年8月30日

国金基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告

一、根据国金基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与联讯证券股份有限公司(以下简称“联讯证券”)签署的基金销售服务协议,自2018年8月31日起,投资者可在联讯证券办理下列基金的开户、申购、赎回、定期定额投资和基金转换等业务。
二〇一八年八月三十日

本公司将依照《证券投资基金信息披露管理办法》、产品合同及相关法律法规的要求,及时、充分披露旗下投资资产支持证券的相关信息。
本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不投资人保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者申购或认购本公司基金时,应认真阅读相关基金基金合同、招募说明书,上述资产支持证券投资方案和风险控制措施。

特此公告。
国金基金管理有限公司
2018年8月30日

注:1、上述开通了转换业务的基金可两两之间相互转换。
2、申购及定期定额投资费率优惠
自2018年8月31日起投资者通过联讯证券进行上述基金的申购及定期定额投资业务,可以享受联讯证券的费率优惠,参与优惠的基金名称、优惠标准、优惠期限以联讯证券公示信息为准。基金名称及费率优惠基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

三、定期定额投资业务的捆绑扣款额
2、投资者可与联讯证券约定每月扣款金额,每期最低申购金额为人民币300元(含申购费)。如销售机构对开通定投业务的基金,以及每期最低申购金额有调整或有其他规定,以销售机构的规定为准。
四、基金转换业务
联讯证券开通本公司旗下三只基金之间的基金转换业务。投资者通过销售机构办理基金转换业务,申购费率按照优惠标准,优惠期限均以销售机构公示信息为准。基金转换费率计算公式以及转换业务规则详见基金管理人网站公告。
五、投资者可通过以下相关咨询有关详情:
1. 联讯证券股份有限公司
客服电话:06664
网址:www.lxsc.com
2. 国金基金管理有限公司
客服电话:4000-2000-18
网址:www.gfund.com
六、重要提示
1、投资者通过联讯证券办理本公司旗下上述开放式基金的销售业务应遵循上述销售机构的相关规定。
2、本公司仅对增加联讯证券为本公司旗下上述开放式基金的销售机构予以说明。
3、本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金合同的投资目标、基金合同约定的投资策略和基金资产的投资方向,也不能保证投资人获得低风险、投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等法律文件。敬请投资者注意投资风险。
特此公告。
国金基金管理有限公司
2018年8月30日

恒越基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告

公告送出日期:2018年8月30日
1、信用风险
基金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,或由由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,造成基金财产损失。
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波动,一般而言,如果市场利率上升,基金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出售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,从而使基金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措施,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流程合规监控,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合法合规。
六、信息披露方式
本公司按照《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,并确保所披露信息的真实性、准确性和完整性。
本公司将在基金年报及半年报中披露持有资产支持证券总额、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,将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。
七、相关提示
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。本基金管理人管理的部分证券投资基金投资资产支持证券,请基金投资者谨慎投资,请基金投资者谨慎投资。
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,但不投资人保证基金一定盈利,也不向投资者承诺投资最低收益。投资者投资本公司管理的各基金时,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。
恒越基金管理有限公司
2018年8月30日

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)等相关法律法规及恒越基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)所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”)的基金合同的规定,本公司旗下基金及未来本公司发行的其他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《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,现将本公司旗下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、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循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比较之后,选择风险收益调整后对价值较高的资产支持证券进行投资,并结合运用久期管理、信用评级支持策略等进行组合管理。同时确定资产支持证券类别资产的合理配置比例,以期获得长期稳定收益。
三、投资限制
本公司旗下基金投资资产支持证券,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的投资限制:
(一) 投资比例限制
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、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%;
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、货币市场基金、货币市场基金规模变动等基金管理人以外的因素致使证券投资基金投资资产支持证券不符合上述第2条和第4条规定比例的,基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。
(二) 投资比例限制
1、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不得超过基金资产净值的比例合计不得超过10%。
2、单只货币市场基金投资于主体信用评级低于AA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、同业存款、相关机构发行的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。
3、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。
四、资产支持证券投资风险提示
尽管基金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
基金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,或由由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,造成基金财产损失。
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波动,一般而言,如果市场利率上升,基金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出售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,从而使基金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措施,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流程合规监控,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合法合规。
六、信息披露方式
本公司按照《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,并确保所披露信息的真实性、准确性和完整性。
本公司将在基金年报及半年报中披露持有资产支持证券总额、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,将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。
七、相关提示
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。本基金管理人管理的部分证券投资基金投资资产支持证券,请基金投资者谨慎投资,请基金投资者谨慎投资。
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,但不投资人保证基金一定盈利,也不向投资者承诺投资最低收益。投资者投资本公司管理的各基金时,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。
恒越基金管理有限公司
2018年8月30日

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)等相关法律法规及恒越基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)所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”)的基金合同的规定,本公司旗下基金及未来本公司发行的其他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《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,现将本公司旗下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、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循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比较之后,选择风险收益调整后对价值较高的资产支持证券进行投资,并结合运用久期管理、信用评级支持策略等进行组合管理。同时确定资产支持证券类别资产的合理配置比例,以期获得长期稳定收益。
三、投资限制
本公司旗下基金投资资产支持证券,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的投资限制:
(一) 投资比例限制
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、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%;
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、货币市场基金、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使证券投资基金投资资产支持证券不符合上述第2条和第4条规定比例的,基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。
(二) 投资比例限制
1、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不得超过基金资产净值的比例合计不得超过10%。
2、单只货币市场基金投资于主体信用评级低于AA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、同业存款、相关机构发行的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。
3、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。
四、资产支持证券投资风险提示
尽管基金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
基金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,或由由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,造成基金财产损失。
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波动,一般而言,如果市场利率上升,基金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出售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,从而使基金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措施,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流程合规监控,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合法合规。
六、信息披露方式
本公司按照《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,并确保所披露信息的真实性、准确性和完整性。
本公司将在基金年报及半年报中披露持有资产支持证券总额、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,将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。
七、相关提示
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。本基金管理人管理的部分证券投资基金投资资产支持证券,请基金投资者谨慎投资,请基金投资者谨慎投资。
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,但不投资人保证基金一定盈利,也不向投资者承诺投资最低收益。投资者投资本公司管理的各基金时,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。
恒越基金管理有限公司
2018年8月30日

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)等相关法律法规及恒越基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)所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”)的基金合同的规定,本公司旗下基金及未来本公司发行的其他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《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,现将本公司旗下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、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循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比较之后,选择风险收益调整后对价值较高的资产支持证券进行投资,并结合运用久期管理、信用评级支持策略等进行组合管理。同时确定资产支持证券类别资产的合理配置比例,以期获得长期稳定收益。
三、投资限制
本公司旗下基金投资资产支持证券,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的投资限制:
(一) 投资比例限制
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、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%;
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、货币市场基金、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使证券投资基金投资资产支持证券不符合上述第2条和第4条规定比例的,基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。
(二) 投资比例限制
1、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不得超过基金资产净值的比例合计不得超过10%。
2、单只货币市场基金投资于主体信用评级低于AA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、同业存款、相关机构发行的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。
3、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。
四、资产支持证券投资风险提示
尽管基金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
基金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,或由由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,造成基金财产损失。
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波动,一般而言,如果市场利率上升,基金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出售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,从而使基金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措施,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流程合规监控,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合法合规。
六、信息披露方式
本公司按照《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,并确保所披露信息的真实性、准确性和完整性。
本公司将在基金年报及半年报中披露持有资产支持证券总额、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,将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。
七、相关提示
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。本基金管理人管理的部分证券投资基金投资资产支持证券,请基金投资者谨慎投资,请基金投资者谨慎投资。
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,但不投资人保证基金一定盈利,也不向投资者承诺投资最低收益。投资者投资本公司管理的各基金时,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。
恒越基金管理有限公司
2018年8月30日

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)等相关法律法规及恒越基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)所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”)的基金合同的规定,本公司旗下基金及未来本公司发行的其他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《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,现将本公司旗下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、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循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比较之后,选择风险收益调整后对价值较高的资产支持证券进行投资,并结合运用久期管理、信用评级支持策略等进行组合管理。同时确定资产支持证券类别资产的合理配置比例,以期获得长期稳定收益。
三、投资限制
本公司旗下基金投资资产支持证券,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的投资限制:
(一) 投资比例限制
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、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%;
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、货币市场基金、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使证券投资基金投资资产支持证券不符合上述第2条和第4条规定比例的,基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。
(二) 投资比例限制
1、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不得超过基金资产净值的比例合计不得超过10%。
2、单只货币市场基金投资于主体信用评级低于AA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、同业存款、相关机构发行的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。
3、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。
四、资产支持证券投资风险提示
尽管基金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
基金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,或由由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,造成基金财产损失。
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波动,一般而言,如果市场利率上升,基金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出售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,从而使基金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措施,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流程合规监控,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合法合规。
六、信息披露方式
本公司按照《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,并确保所披露信息的真实性、准确性和完整性。
本公司将在基金年报及半年报中披露持有资产支持证券总额、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,将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。
七、相关提示
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。本基金管理人管理的部分证券投资基金投资资产支持证券,请基金投资者谨慎投资,请基金投资者谨慎投资。
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,但不投资人保证基金一定盈利,也不向投资者承诺投资最低收益。投资者投资本公司管理的各基金时,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。
恒越基金管理有限公司
2018年8月30日

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)等相关法律法规及恒越基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)所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”)的基金合同的规定,本公司旗下基金及未来本公司发行的其他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《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,现将本公司旗下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、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循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比较之后,选择风险收益调整后对价值较高的资产支持证券进行投资,并结合运用久期管理、信用评级支持策略等进行组合管理。同时确定资产支持证券类别资产的合理配置比例,以期获得长期稳定收益。
三、投资限制
本公司旗下基金投资资产支持证券,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