

# 南方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）及相关基金合同的规定，南方基金管理有限公司（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

本公司管理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，收益率曲线、个券选择等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 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、单只证券投资基金持有的资产支持证券的比例不得超过该资产支持证券总规模的 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、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%。
- 5、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。
- 6、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本公司管理基金投资资产支持证券不符合上述规定比例的，本公司将在 10 个交易日内调整完毕。

7、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。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，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、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信用评级。

2、本公司货币市场证券投资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，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、证券投资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

鉴于投资资产支持证券可能面临的利率风险、信用风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险，本公司将通过内部信用评级和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》、基金合同、招募说明书及其他有关规定的要求，在旗下有关基金法定信息披露文件中及时、充分地披露有关基金投资资产支持证券的相关信息。

## 五、相关提示

此前本公司各基金关于投资资产支持证券的公告与本公告不一致的，以本公告为准。

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。投资者申购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。

南方基金管理有限公司

2015年5月7日