

中海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）及基金合同的规定，中海基金管理有限公司（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于资产支持证券，将严格依据各基金合同中约定的投资策略进行投资。基金合同中未有具体约定的，将依据如下投资策略进行投资：

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%；
- 2、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；
- 3、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%；
- 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、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。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；

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的，本公司将在法定期限内调整完毕。

（二）信用评级限制

1、证券投资基金投资的资产支持证券须有具有评级资质的资信评级机构的持续信用评级。

2、本公司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，应遵照基金合同中有关证券信用级别的限制；基金合同未订明相应的证券信用级别限制的，则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

本公司将投资资产支持证券的风险管理纳入总体的风险管理体系，充分识别和评估投资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、操作风险和法律风险，建立相应的风险评估流程，并制订了相应的投资审批程序和风险控制制度。

（一）各基金严格按照法律法规、基金合同的约定合理控制基金投资资产支持证券的比例。

（二）公司固定收益研究员对公司所管理基金持仓的资产支持证券进行持续的基本面及信用评级跟踪研究，对基金拟投资资产支持证券需完成专项分析报告。

（三）基金经理在固定收益研究员研究成果的基础之上，本着审慎、勤勉尽责的原则进行资产支持证券投资，根据各基金的投资风格和流动性特点，兼

顾该基金投资的安全性、流动性和收益性，防范信用风险、流动性风险等各种风险。

（四）公司风控稽核部门在公司投资管理系统中对基金投资资产支持证券的投资比例进行事前的风控阈值设置，并做好投资管理系统风控阈值的事中监控、记录与事后提示。

（五）公司金融工程团队应将基金资产支持证券投资风险作为对基金实施定期风险评估的重要关注对象。

四、信息披露方式

（一）本公司将依法披露旗下证券投资基金投资资产支持证券的情况，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性，不存在任何形式的虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

（二）本公司将在基金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基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

（三）本公司将在基金季度报告中披露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。

五、相关提示

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。

中海基金管理有限公司

2015 年 10 月 20 日