

国联安基金管理有限公司

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,国联安基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下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。现将本公司旗下基金投资资产支持证券的投资方案及相关事宜公告如下::

一、投资策略

本公司旗下证券投资基金投资资产支持证券,将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、资产池结构及资产池资产所在行业景气、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素,评估违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用数量化定价模型,评估其内在价值。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,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,争取获得长期稳定收益。

二、投资限制

本公司旗下基金投资于资产支持证券,除了遵守基金合同中已有的投资比例限制外,还将遵守下述有关资产支持证券投资比例的限制:

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、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

持证券不符合上述第 2 条和第 4 条规定比例的,本公司应当在 10 个交易日内调整完毕。

6、货币市场证券投资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。

7、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,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。

三、信息披露方式

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。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。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。

风险提示:

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告。

国联安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十二日