

南方宝元基金关于资产支持证券投资方案的公告

根据证监字〔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》（以下简称“《通知》”）和南方宝元基金（以下简称“本基金”）基金合同的规定，本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》、《证券投资基金运作管理办法》、本基金基金合同、招募说明书及相关法律法规的规定，特制定本基金资产支持证券投资方案并公告如下：

一、投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、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，以期获得长期稳定收益。

二、投资比例限制

本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、本基金投资于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、本基金持有的同一（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、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过本基金资产净值的10%。

4、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过本基金资产净值的20%。

5、本基金管理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%。

6、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基金投资资产支持证券不符合上述规定比例的，基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。

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，本基金管理人将通过内部信用评级、量化模型分析、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

本基金管理人将依照《证券投资基金信息披露管理办法》、《通知》、本基金基金合同、招募说明书及其他有关规定的要求，在本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

南方基金管理有限公司
二〇〇六年五月三十日