

# 国金基金管理有限公司

---

## 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,特制定本公司旗下基金资产支持证券投资方案并公告如下:

#### 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,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,进行资产支持证券的投资。本公司旗下基金将本着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、单只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占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 AAA 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、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。若所投资的资产支持证券的原始权益人无主体信用评级，则按低于 AAA 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。除货币市场基金以外的公司管理的其他基金可根据合同约定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剩余天数计算。

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（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之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 交易日内调整完毕；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之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。

## （二）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。

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。

### （三）其他要求：

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交易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，本公司将通过内部信用评级、投资组合管理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，本公司将建立覆盖投资全过程的事前、事中和事后控制措施，确保资产支持证券投资的合法合规。

## 四、信息披露

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、充分披露旗下投资组合投资资产支持证券的相关信息。

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

二〇一八年八月三十日