

国开泰富基金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，国开泰富基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）管理的国开泰富岁月鎏金定期开放信用债券型证券投资基金以及本公告生效后成立的可投资于资产支持证券的证券投资基金，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

（一）通过收益率曲线分析、信用价差分析与流动性分析，综合考虑提前偿付风险、利率风险及再投资风险等因素，筛选出经风险调整的具有较高投资价值的资产支持证券，构建资产支持证券产品投资池，并定期更新；

（二）根据国内目前资产支持证券市场的发展状况，具有低流动性、相对收益较高、分层增信的特征，采取有效的组合管理策略，将资产支持证券作为提高基金组合收益率和降低组合风险的工具：

（1）针对流动性要求较低的基金，买入部分资产支持证券并持有到期，获取相对较高的稳定收益；

（2）针对流动性要求较高的基金，构建资产支持证券与高流动性债券的组合，利用其他高流动性债券确保基金日常流动性，而将资产支持证券作为保证组合收益率的品种；

（三）针对银行间市场和交易所市场不同的市场环境，根据对标的资产、市场供需等影响资产支持证券价值因素的深入研究，在通过风险评估模型定量分析后，在可承受风险限度内有限度进行以获取价差为目标的资产支持证券投资。

二、风险控制措施

1、比例限制

（1）单只基金投资的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不超过该资产支持证券规模的 10%；

（2）单只基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不超过该基金资产净值的 10%；

（3）单只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；

（4）本公司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，不超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（5）因证券市场波动、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资资产支持证券不符合上述第（2）项、第（3）项规定的比例的，本公司将在 10 个交易日之内调整完毕。

2、期限限制

（1）国开泰富岁月鎏金定期开放信用债券型证券投资基金以及本公告生效后成立的可投资于资产支持证券的证券投资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；

（2）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。

3、级别限制

(1) 国开泰富岁月鎏金定期开放信用债券型证券投资基金以及本公告生效后成立的可投资于资产支持证券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;

(2) 本公司管理的全部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,将在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

中国证监会另有规定的,不受上述各项规定的限制。

三、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。

四、相关提示

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者在投资前,应当认真阅读本公司旗下基金的基金合同、招募说明书和本投资方案。

特此公告。

国开泰富基金管理有限责任公司

2014 年 9 月 17 日