

# 中银国际证券有限责任公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、中国证监会证监基金字[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》以及各相关基金合同的约定，现将中银国际证券有限责任公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”）旗下证券投资基金投资资产支持证券的投资方案及风险控制措施等事项公告如下：

## 一、适用范围

本公司旗下所有可投资于资产支持证券的证券投资基金，包括本公告公布后成立的可投资于资产支持证券的证券投资基金。

## 二、投资策略

本公司旗下基金投资资产支持证券，将综合运用信用管理、久期管理、收益率曲线、个券选择等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同中已有的投资策略的基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的资产支持证券进行投资，以期为投资者谋求较高的收益。

## 三、投资限制

本公司旗下基金投资于资产支持证券，除了遵守各基金合同中约定的投资限制外，还将遵守下述有关资产支持证券投资限制：

### （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、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，应当在 10 个交易日内调整完毕。

### （二）投资期限限制

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。

### （三）信用评级限制

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，应遵守基金合同规定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。

3、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。

## 四、风险控制措施

本公司旗下基金开展资产支持证券交易业务前，将建立相应的风险评估流程，制订相应的投资审批程序和风险控制制度，并将资产支持证券的风险管理纳入公司总体风险管理体系，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，通过内部评级、敏感性分析、压力测试、久期匹配等措施控制相应的风险。

同时，本公司将通过事前控制、事中监督和事后检查等方式，对资产支持证券投资进行全程合规监控，确保资产支持证券投资的合法合规。

#### 五、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，在基金年报及半年报中披露其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，在基金季度报告中披露其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。

#### 六、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。投资者投资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。敬请投资者关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动在内的各项风险。

特此公告。

中银国际证券有限责任公司

2017 年 2 月 8 日