

## 长信基金管理有限责任公司

### 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）的规定及长信基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）所管理的公开募集证券投资基金（以下简称“基金”）的基金合同，本公司旗下基金及未来本公司发行的其他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》、《公开募集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、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

本公司旗下基金在严格遵守法律法规和基金合同的基础上，根据利率风险、信用风险、流动性风险、违约风险等变化，在对资产支持证券的基础资产质量、发行条款、提前偿付风险等进行仔细研究和比较之后，选择风险收益调整后相对价值较高的资产支持证券进行投资，并综合运用久期管理、行业及地域分析、信用评级支持等策略进行组合管理。同时将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低组合流动性风险。

#### 三、投资限制

本公司管理基金投资于资产支持证券，除了遵守各基金合同中已有的投资限制外，还将遵守下述有关资产支持证券投资比例与期限的限制：

- 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、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。

4、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%。

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第2条和第3条规定比例的，基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。

6、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。

7、本公司上述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，投资的资产支持证券的信用评级则应为BBB 以上(含BBB)。

8、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。

9、法律法规或基金合同对本公司旗下基金投资资产支持证券的投资限制有特殊规定的，以法律法规或该基金基金合同的特殊规定为准。

#### **四、风险控制措施**

本公司将在充分考量各基金组合投资风格和流动性特点的基础上，通过内部信用评估、投资授信控制、投资交易监控等方法，防范资产支持证券投资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。

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

#### **五、信息披露方式**

本公司将按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《关于证券投资基金投

资产支持证券有关事项的通知》、本公司旗下基金基金合同、招募说明书及其他有关规定的要求，及时、充分披露所管理的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，不得有虚假记载、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所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所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、相关提示

法律法规对上述事项另有规定时，从其规定执行。

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，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。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。

投资者可通过本基金管理人的网站：[www.cxfund.com.cn](http://www.cxfund.com.cn)或客户服务电话：400-700-5566了解详情。

**特此公告。**

长信基金管理有限责任公司

2018年6月7日