# 长城证券股份有限公司
# 关于以通讯方式召开长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会第二次提示性公告

长城证券股份有限公司已分别于2025 年1月23日和2025 年1月24日在中国证监会规定媒介发布了《长城证券股份有限公司关于以通讯方式召开长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会的公告》《长城证券股份有限公司关于以通讯方式召开长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会第一次提示性公告》。为了使本次集合计划份额持有人大会顺利召开,现发布本次集合计划份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")和《长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称"《集合计划合同》")的有关规定,长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划(A类集合计划份额代码:970064,B类集合计划份额代码:970065,C类集合计划份额代码:970066,以下简称"本集合计划")的管理人长城证券股份有限公司(以下简称"集合计划管理人")经与本集合计划托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称"集合计划托管人")协商一致,决定以通讯方式召开本集合计划的份额持有人大会,审议《关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案》,会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式

2、会议投票表决起止时间:自2025年1月24日起至2025年2月21日17:00止(纸质投票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的,投票表决时间以表决票收件人收到表决票时间为准;电话授权以集合计划管理人相应系统记录时间为准)

3、会议计票日:表决截止日后2个工作日内

4、会议纸质表决票的寄达地点:

收件人:长城证券股份有限公司

地址:广东省深圳市福田区金田路2026号能源大厦南塔楼11层

邮政编码:518033

联系人:傅瑶

联系电话:0755-82924789

通过专人送交、邮寄送达的,请在信封背面注明系用于集合计划份额持有人大会表决之用(如"长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决专用")。

二、会议审议事项

本次会议审议事项为《关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案》(见附件一)。

上述议案的说明请参见《关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金议案的说明》(见附件四)。

三、权益登记日

本次会议的权益登记日为2025年1月23日,即该日交易时间结束后,在本集合计划登记机构登记在册的本集合计划份额持有人或其授权的代理人均有权参加本次集合计划份额持有人大会并表决。

四、投票方式

(一)纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次持有人大会的纸质表决票见附件二。本集合计划份额持有人可通过剪报、复印或登录集合计划管理人网站(www.cgws.com)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)下载并打印表决票。

2、本集合计划份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,其中:

(1)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人有效身份证件正反面复印件;

(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本机构公章或经授权的业务章(以下合称"公章"),并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等);合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本机构公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的有效身份证件正反面、护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3)以上各项及本公告全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等文件,以本集合计划管理人的认可为准。

3、集合计划份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2025年1月24日起至2025年2月21日17:00止(以表决票收件人收到表决票的时间为准)通过专人送交、邮寄送达至以下地址:

收件人:长城证券股份有限公司

地址:广东省深圳市福田区金田路2026号能源大厦南塔楼11层

邮政编码:518033

联系人:傅瑶

联系电话:0755-82924789

通过专人送交、邮寄送达的,请在信封背面注明系用于本集合计划份额持有人大会表决之用(如"长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决专用")。

(二)其他投票方式

集合计划管理人可以根据实际需要,增加或调整本次持有人大会的投票方式并在规定媒介上公告。

五、授权

为便于集合计划份额持有人有尽可能多的机会参与本次会议,使集合计划份额持有人在本次会议上充分表达其意志,集合计划份额持有人除可以直接投票外,还可以授权他人代其在集合计划份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《集合计划合同》的约定,集合计划份额持有人授权他人在集合计划份额持有人大会上表决需符合以下规则:

(一)委托人

本集合计划的集合计划份额持有人可委托他人代理行使本次集合计划份额持有人大会的表决权。

集合计划份额持有人授权他人行使表决权的票数按该集合计划份额持有人在权益登记日所持有的全部集合计划份额数计算,一份集合计划份额代表一票表决权。集合计划份额持有人在权益登记日未持有本集合计划份额的,授权无效。

集合计划份额持有人在权益登记日是否持有集合计划份额以及所持有的集合计划份额的数额以登记机构的登记为准。

(二)受托人(代理人)

集合计划份额持有人可以委托本集合计划管理人以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次集合计划份额持有人大会的表决权。

(三)授权方式

本集合计划的集合计划份额持有人可通过纸面、电话的方式授权受托人代为行使表决权。份额持有人通过纸面方式授权的,授权委托书的样本请见本公告附件三。集合计划份额持有人可通过剪报、复印或登录集合计划管理人网站(www.cgws.com)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)下载并打印等方式获取授权委托书样本。

1、集合计划份额持有人进行纸面授权所需提供的文件:

(1)个人集合计划份额持有人委托他人投票的,应由受托人在表决票上签字或盖章,并提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本)、集合计划份额持有人的有效身份证件正反面复印件。如受托人为个人,还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。

(2)机构集合计划份额持有人委托他人投票的,应由受托人在表决票上签字或加盖公章,并提供由委托人填妥的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本)并在授权委托书上加盖该机构公章、该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。如受托人为个人,还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。合格境外机构投资者委托他人投票的,应由受托人在表决票上签字或加盖公章,并提供由委托人填妥的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本)并在授权委托书上加盖该机构公章(如有)或由授权代表签字(如无公章)、该授权代表的有效身份证件正反面、护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。如受托人为个人,还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。

(3)以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等,以集合计划管理人的认可为准。

(4)授权文件的送达

份额持有人授权文件的送达方式、送达时间、收件地址、联系方式等与表决票送达要求一致。

2、电话授权(仅适用于个人集合计划份额持有人)

为方便集合计划份额持有人参与集合计划份额持有人大会投票,自2025年1月24日起至2025年2月19日17:00止(以集合计划管理人系统记录时间为准),集合计划份额持有人可拨打集合计划管理人客服电话(95514)并按提示转人工坐席,待确认份额持有人同意参与本次份额持有人大会并授权集合计划管理人进行投票,并以回答集合计划管理人人工坐席提问方式核实身份后,由人工坐席根据集合计划份额持有人意愿进行授权记录从而完成授权。集合计划管理人也可主动与预留联系方式的集合计划份额持有人取得联系,待确认份额持有人同意参与本次份额持有人大会并授权集合计划管理人进行投票,并在通话过程中以回答集合计划管理人人工坐席提问方式核实集合计划份额持有人身份后,由人工坐席根据集合计划份额持有人意愿进行授权记录从而完成授权。

集合计划管理人核实份额持有人身份的提问包括但不限于份额持有人姓名、身份证号及预留手机号等。

为保护集合计划份额持有人利益,整个通话过程将被录音。集合计划份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人集合计划份额持有人,对机构集合计划份额持有人暂不开通。

3、授权效力确定规则

(1)如果同一集合计划份额存在多次以有效纸面方式授权的,以时间在最后一次送达集合计划管理人的纸面授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项,不能确定最后一次纸面授权的,若授权表示一致,以一致的授权表示为准;若授权表示不一致,视为无效授权;

(2)如果同一集合计划份额存在多次非纸面方式授权的,以时间在最后一次送达集合计划管理人的非纸面授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项,不能确定最后一次非纸面授权的,若授权表示一致,以一致的授权表示为准;若授权表示不一致,视为无效授权;

(3)同一委托人存在有效的纸面授权和有效的其他方式授权的,以有效的纸面授权为准。

(4)如委托人既进行委托授权,自身又送达了有效表决票,则以自身有效表决票为准。

(5)份额持有人的授权意见代表份额持有人在权益登记日所持有全部集合计划份额的授权意见。

4、授权时间

上述授权有效期自授权之日起至审议上述事项的份额持有人大会会议结束之日止。若本集合计划重新召开审议相同议案的持有人大会的,除非授权文件另有载明,上述授权继续有效。但如果授权方式发生变化或者份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集份额持有人大会的通知。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为:由本集合计划管理人授权的两名监督员在集合计划托管人(中国工商银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。集合计划托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

2、权益登记日登记在册的集合计划份额持有人所持有每份集合计划份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1)表决票通过专人送交或邮寄送达本公告规定的收件人的,表决时间以集合计划管理人收到时间为准。2025年2月21日17:00以后送达集合计划管理人的,为无效表决。

(2)表决票的效力认定:

①纸质表决票填写完整清晰,所提供文件符合本公告规定,且在截止时间之前送达集合计划管理人的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

②如表决票上的表决意见未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断,但其他各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决票并按"弃权"计入对应的表决结果,其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

③如表决票上签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明集合计划份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达集合计划管理人的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

④集合计划份额持有人重复提交表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表决意见不相同,则按如下原则处理:

A.送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

B.送达时间为同一天的,视为在同一表决票上做出了不同表决意见,计入弃权表决票;

C.送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以集合计划管理人收到的时间为准。

七、决议生效的条件

本次会议召开的条件为:本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一(含二分之一)。

本会议表决的票数要求为:《关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案》须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

集合计划份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效,集合计划管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。集合计划份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人应当执行生效的集合计划份额持有人大会的决议。生效的集合计划份额持有人大会决议对全体集合计划份额持有人、集合计划管理人、集合计划托管人均有约束力。

八、二次召集集合计划份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《集合计划合同》的规定,本次持有人大会需要参加大会的集合计划份额持有人或其各自代理人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一(含二分之一),方可召开。如果本次集合计划份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开,集合计划管理人可在本次公告的集合计划份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就同一议案重新召集集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会,应当由代表本集合计划在权益登记日集合计划总份额三分之一以上(含三分之一)集合计划份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。

重新召开集合计划份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次集合计划份额持有人大会授权期间集合计划份额持有人作出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者集合计划份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集集合计划份额持有人大会的通知(如有)。

九、本次持有人大会相关机构

1、召集人:长城证券股份有限公司

联系地址:广东省深圳市福田区金田路2026号能源大厦南塔楼11层

联系人:傅瑶

客户服务联系电话:95514

网址:www.cgws.com

2、集合计划托管人:中国工商银行股份有限公司

住 所:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

联系电话:010-66105799

网址:https://www.icbc.com.cn/

3、公证机关:广东省深圳市深圳公证处

联系人:丁青松、卢润川

联系电话:0755-83024185

4、见证律师事务所:上海市通力律师事务所

联系电话:021-31358666

十、重要提示

1、本公告的议案表决生效后,登记机构由中国证券登记结算有限责任公司变更为长城基金管理有限公司,份额持有人需在长城基金管理有限公司开立基金账户,可由原销售机构根据其本人已经提供的有效资料代为办理基金账户的开立手续。同时,份额持有人也可以自行办理基金账户开立手续,份额持有人可联系原销售机构网点,通过营业网点临柜办理或通过手机软件线上办理的方式自行办理,办理起止日期以原销售机构另行通知为准。未在长城基金管理有限公司开立基金账户的,份额持有人后续申购、赎回基金份额的便利性将受到影响。

2、请集合计划份额持有人在提交表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

3、根据《集合计划合同》的规定,本次集合计划份额持有人大会费用以及会计师费、律师费等相关费用可从集合计划资产列支。

4、本次集合计划份额持有人大会有关公告可通过本集合计划管理人网站(www.cgws.com)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)查阅,投资者如有任何疑问,可致电本集合计划管理人客户服务电话95514咨询。

5、本公告的有关内容由长城证券股份有限公司负责解释。

附件一:关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案

附件二:长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决票

附件三:长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会授权委托书

附件四:关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金议案的说明

特此公告。

**长城证券股份有限公司**

**2025年1月27日**

附件一:

关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案

长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人:

长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划(集合计划份额代码:970064,B类集合计划份额代码:970065,C类集合计划份额代码:970066,以下简称"本集合计划")经中国证监会2021年6月23日《关于准予长城季季红2号集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函[2021]1942号),由长城季季红2号集合资产管理计划对标公开募集证券投资基金法律法规的要求整改规范及合同变更而来,本集合计划管理人为长城证券股份有限公司(以下简称"集合计划管理人"),集合计划托管人为中国工商银行股份有限公司。《长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称"资产管理合同")于2021年9月14日生效。

《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(证监会公告〔2018〕39号,以下简称"《操作指引》")及资产管理合同第三部分"集合计划的基本情况"对本集合计划存续期限的约定"本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续至2025年3月13日,存续期限届满后,按照中国证监会有关规定执行。"。鉴于以上情况,综合考虑份额持有人需求及本集合计划的长远发展,为充分保护份额持有人利益,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》、《操作指引》等法律法规的规定及资产管理合同的约定,集合计划管理人与集合计划托管人协商一致,提议本集合计划变更注册,将集合计划管理人由长城证券股份有限公司变更为集合计划管理人参股公司长城基金管理有限公司,长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划拟相应变更为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金,并调整产品类别、产品期限、登记机构、投资目标、投资比例、投资限制、投资策略、业绩比较基准等并修订合同。

本次变更的主要内容包括但不限于:

| 变更内容 | 变更前 | 变更后 |
|---|---|---|
| 产品名称 | 长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划 | 长城三个月滚动持有债券型证券投资基金 |
| 管理人 | 长城证券股份有限公司 | 长城基金管理有限公司 |
| 产品类别 | 债券型集合资产管理计划 | 债券型证券投资基金 |
| 产品期限 | 固定存续期限 | 不定期 |
| 登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 长城基金管理有限公司 |
| 投资目标 | 在追求资产安全性的基础上,力争满足客户对于短期固定周期的资金配置和保值增值的需求。 | 在追求资产安全性的基础上,力争实现资产的长期稳健增值。 |
| 投资比例 | 本集合计划的投资组合比例为:本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 | 本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;本基金投资于可转换债券(含分离交易可转债),可交换债券的比例不超过基金资产的20%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 |
| 投资策略 | 5、信用债投资策略<br>本集合计划将通过承担适度的信用风险来获取信用溢价的策略参与信用债的投资。本集合计划将在公司内外部评级的基础上和内部的信用风险控制的框架下,通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素,判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势,确定信用债券的配置。<br>本集合计划主动投资于信用债,其信用评级需在AA(含)以上,且应当遵守下列要求:<br>(1)本集合计划投资于AAA信用评级的信用债的比例占信用债资产的50%- 100%;<br>(2)本集合计划投资于AA+信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-50%;<br>(3)本集合计划投资于AA信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-20%。<br>信用评级参照评级机构(不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构)评定的最新债项评级,无债项评级的参照主体评级。 | 5、信用债(含资产支持证券,下同)投资策略<br>本基金将通过承担适度的信用风险来获取信用溢价的策略参与信用债的投资。本基金将在公司内外部评级的基础上和内部的信用风险控制的框架下,通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素,判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势,确定信用债券的配置。<br>本基金主动投资于信用债,其信用评级需在AA+(含)以上,且应当遵守下列要求:<br>(1)本基金投资于AAA信用评级的信用债的比例占信用债资产的50%- 100%;<br>(2)本基金投资于AA+信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-50%。<br>信用评级参照评级机构(不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构)评定的最新债项评级,无债项评级的参照主体评级。本基金持有信用债期间,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个月内调整至符合约定,因流动性或政策等因素限制导致无法调整的除外。本基金对信用债评级的认定主要参照基金管理人选定的评级机构出具的信用评级,可以结合基金管理人的内部信用评级进行综合认定。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述比例要求。 |
| | 7、可转换债券、可交换债券投资策略<br>可转换债券、可交换债券不受前述信用债评级和投资比例限制。本集合计划投资于可转换债券(含分离交易可转债),可交换债券的比例占资产总值的0%-20%。本集合计划主动投资于单一可转换债券(含可分离交易可转债),可交换债券,其市值不得超过集合计划资产净值的5%。 | 7、可转换债券、可交换债券投资策略 |
| 投资限制 | (二)资产支持证券投资策略<br>本集合计划将对基础资产质量、主体资质、未来现金流、发行条款、增信措施以及市场利率等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并采用基本面分析和数量化模型相结合的方式,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。<br>(9)本集合计划应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。本集合计划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;<br>(10)本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的40%,进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;<br>(16)本集合计划主动投资于信用债,其信用评级需在AA(含)以上,且应当遵守下列要求:<br>1)本集合计划投资于AAA信用评级的信用债的比例占信用债资产的50%- 100%;<br>2)本集合计划投资于AA+信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-50%;<br>3)本集合计划投资于AA信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-20%。<br>信用评级参照评级机构(不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构)评定的最新债项评级,无债项评级的参照主体评级。可转换债券、可交换债券不受此评级和投资比例限制。<br>本集合计划投资于可转换债券(含分离交易可转债),可交换债券的比例占资产总值的0%-20%。本集合计划主动投资于单一可转换债券(含可分离交易可转债),可交换债券,其市值不得超过集合计划资产净值的5%。 | (14)本基金投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例不超过基金资产的20%。 |
| 业绩比较基准 | 中债新综合财富(1 年以下)指数收益率×60%+中债新综合财富(1-3 年)指数收益率×30%+一年期定期存款利率×10% | 中债综合全价(总值)指数收益率×90% +一年期定期存款利率×10% |

具体修改内容和程序详见《关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金议案的说明》(附件四)。

如本次持有人大会议案表决通过,为保障投资者合法权益,本集合计划将安排特别开放期(具体以管理人届时发布的公告为准),在特别开放期内,本集合计划各类份额的份额持有人均可通过本集合计划销售机构办理赎回申请,A类、C类份额赎回不受滚动运作期限制。由于本集合计划需应对赎回等情况,份额持有人同意在特别开放期豁免本集合计划资产管理合同中关于投资限制项下组合限制等条款。

同时,为保证顺利实施本集合计划变更注册的方案,本次持有人大会议案通过后,集合计划管理人可根据相应要求暂停本集合计划的申购、赎回业务,暂停申购、赎回的具体安排以后续公告为准,请投资者注意查看。修改后的基金合同等法律文件自基金管理人长城基金管理有限公司公告的生效之日起生效,后续重新开放申购赎回业务办理时间亦以基金管理人长城基金管理有限公司公告为准,请投资者注意查看并合理安排资金。

因登记机构由中国证券登记结算有限责任公司变更为长城基金管理有限公司,份额持有人需在长城基金管理有限公司开立基金账户,可由原销售机构根据其本人已经提供的有效资料代为办理基金账户的开立手续。同时,份额持有人也可以自行办理基金账户开立手续,份额持有人可联系原销售机构网点,通过营业网点临柜办理或通过手机软件线上办理的方式自行办理,办理起止日期以原销售机构另行通知为准。未在长城基金管理有限公司开立基金账户的,份额持有人后续申购、赎回基金份额的便利性将受到影响。

为保护集合计划份额持有人的利益,提议授权集合计划管理人根据持有人大会决议对资产管理合同等法律文件进行修改,并办理本次变更注册的相关事宜,包括但不限于根据相关情况,决定采取相关集合计划变更的措施以及确定集合计划变更各项工作的具体时间。

以上议案,请予审议。

附件二:

| 长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决票 | | | |
|---|---|---|---|
| 集合计划份额持有人基本资料 | | | |
| 集合计划份额持有人姓名/名称: | | | |
| 基金账户号: | | | |
| 证件号码(身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码): | | | |
| 如集合计划份额持有人委托他人代为投票,请填写 | | | |
| 代理人(受托人)姓名/名称: | | | |
| 代理人(受托人)证件号码(身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码): | | | |
| 审议事项 | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 《关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案》 | | | |
| 集合计划份额持有人/代理人(受托人)签名或盖章<br>年 月 日 | | | |
| 说明:<br>请以打"√"方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表集合计划份额持有人所持全部集合计划份额的表决意见。如表决票上的表决意见未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断,但其他各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决票,并按"弃权"计入对应的表决结果,其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。<br>"基金账户号"仅持持有本集合计划份额的基金账户号,同一集合计划份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有集合计划份额分别行使表决权的,应当填写基金账户号;其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此集合计划份额持有人所持有的本集合计划所有份额。 | | | |

(本表决票可剪报、复印或登录集合计划管理人网站(www.cgws.com)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)下载并打印,在填写完整并签字或盖章后方为有效)。

附件三:

长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会授权委托书

兹全权委托_____先生/女士/机构代表本人/本机构参加以通讯方式召开的投票截止日为___年__月__日的长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会,并代为全权行使对所有议案的表决权。本授权不得转授权。若长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划重新召开审议相同议案的持有人大会的,本授权继续有效。但如果授权方式发生变化或者份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准。

委托人(签字/盖章):

委托人证件类型及证件号码:

委托人基金账户号:

受托人(签字/盖章):

受托人证件类型及证件号码:

委托日期: 年 月 日

授权委托书填写注意事项:

1、本授权委托书中"基金账户号",指集合计划份额持有人持有长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额的基金账户号。同一集合计划份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有集合计划份额分别行使表决权的,应当填写多个基金账户号,其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此集合计划份额持有人所持有的长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划的所有集合计划份额。

2、此授权委托书剪报、复印或登录集合计划管理人网站(www.cgws.com)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)下载并打印,在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四:

关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金议案的说明

一、声明

《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(以下简称"《操作指引》")及资产管理合同第三部分"集合计划的基本情况"对本集合计划存续期限的约定"本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续至2025年3月13日,存续期限届满后,按照中国证监会有关规定执行。"。鉴于以上情况,综合考虑集合计划份额持有人需求及本集合计划的长远发展,为充分保护集合计划份额持有人利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《操作指引》等法律法规的规定及《长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称"《集合计划合同》")的约定,经与集合计划托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,集合计划管理人提议以通讯方式召开集合计划份额持有人大会,审议《关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案》(以下简称"议案"),将集合计划管理人由长城证券股份有限公司变更为其参股公司长城基金管理有限公司,长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划拟相应变更为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金,并调整产品类别、产品期限、登记机构、投资目标、投资比例、投资限制、投资策略、业绩比较基准等并修订合同。

本次议案须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效,存在无法获得集合计划份额持有人大会表决通过的可能。

集合计划持有人大会的决议自表决通过之日起生效,集合计划管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。中国证监会对本次持有人大会决议的备案,不表明其对本次集合计划变更方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、修改方案要点

本次变更的主要内容如下:

| 变更内容 | 变更前 | 变更后 |
|---|---|---|
| 产品名称 | 长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划 | 长城三个月滚动持有债券型证券投资基金 |
| 管理人 | 长城证券股份有限公司 | 长城基金管理有限公司 |
| 产品类别 | 债券型集合资产管理计划 | 债券型证券投资基金 |
| 产品期限 | 固定存续期限 | 不定期 |
| 登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 长城基金管理有限公司 |
| 投资目标 | 在追求资产安全性的基础上,力争满足客户对于短期固定周期的资金配置和保值增值的需求。 | 在追求资产安全性的基础上,力争实现资产的长期稳健增值。 |
| 投资比例 | 本集合计划的投资组合比例为:本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 | 本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;本基金投资于可转换债券(含分离交易可转债),可交换债券的比例不超过基金资产的20%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 |
| 投资策略 | 5、信用债投资策略<br>本集合计划将通过承担适度的信用风险来获取信用溢价的策略参与信用债的投资。本集合计划将在公司内外部评级的基础上和内部的信用风险控制的框架下,通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素,判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势,确定信用债券的配置。<br>本集合计划主动投资于信用债,其信用评级需在AA(含)以上,且应当遵守下列要求:<br>(1)本集合计划投资于AAA信用评级的信用债的比例占信用债资产的50%- 100%;<br>(2)本集合计划投资于AA+信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-50%;<br>(3)本集合计划投资于AA信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-20%。<br>信用评级参照评级机构(不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构)评定的最新债项评级,无债项评级的参照主体评级。本基金持有信用债期间,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个月内调整至符合约定,因流动性或政策等因素限制导致无法调整的除外。本基金对信用债评级的认定主要参照基金管理人选定的评级机构出具的信用评级,可以结合基金管理人的内部信用评级进行综合认定。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述比例要求。 | 5、信用债(含资产支持证券,下同)投资策略<br>本基金将通过承担适度的信用风险来获取信用溢价的策略参与信用债的投资。本基金将在公司内外部评级的基础上和内部的信用风险控制的框架下,通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素,判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势,确定信用债券的配置。<br>本基金主动投资于信用债,其信用评级需在AA+(含)以上,且应当遵守下列要求:<br>(1)本基金投资于AAA信用评级的信用债的比例占信用债资产的50%- 100%;<br>(2)本基金投资于AA+信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-50%。<br>信用评级参照评级机构(不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构)评定的最新债项评级,无债项评级的参照主体评级。本基金持有信用债期间,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个月内调整至符合约定,因流动性或政策等因素限制导致无法调整的除外。本基金对信用债评级的认定主要参照基金管理人选定的评级机构出具的信用评级,可以结合基金管理人的内部信用评级进行综合认定。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述比例要求。 |
| | 7、可转换债券、可交换债券投资策略<br>可转换债券、可交换债券不受前述信用债评级和投资比例限制。本集合计划投资于可转换债券(含分离交易可转债),可交换债券的比例占资产总值的0%-20%。本集合计划主动投资于单一可转换债券(含可分离交易可转债),可交换债券,其市值不得超过集合计划资产净值的5%。 | 7、可转换债券