

关于以通讯方式召开长城久盈纯债分级债券型证券投资基金 基金份额持有人大会的第一次提示性公告

长城基金管理有限公司已于2018年11月20日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及长城基金管理有限公司网站（www.ccfund.com.cn）发布了《关于以通讯方式召开长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开本次会议的第一次提示性公告。

一、召开会议基本情况

为了更好地满足广大投资者的需求，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》等法律法规的规定和《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，长城久盈纯债分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人长城基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型方案等相关事宜，将本基金转型为“长城久盈纯债债券型证券投资基金”，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2018年11月23日起至2018年12月19日17:00止（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）基金份额持有人或其代理人可通过专人送交、邮寄送达至以下地址的下述收件人。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

公证机关：深圳市深圳公证处

收件人：丁青松、卢润川

联系地址：深圳市福田区深南大道4013号兴业银行大厦17楼1706/1708

联系电话：0755-83024185/0755-83024187

邮政编码：518048

请在信封表面注明：“长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-8868-666咨询。

二、会议审议事项

《关于长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明及基金合同的详细修订内容详见《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型方案说明书》（见附件四）。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年11月23日，即在2018年11月23日下午交易时间结束后，在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括久盈A份额与久盈B份额的基金份额持有人）或其授权的代理人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录本基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）下载并打印表决票。

2、基金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公章（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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）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和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（4）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（5）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的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

盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（6）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，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和填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（7）以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的授权委托书等相关文件在前述会议投票表决起止时间内（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址的下述收件人：

公证机关：深圳市深圳公证处

收件人：丁青松、卢润川

联系地址：深圳市福田区深南大道 4013 号兴业银行大厦 17 楼 1706/1708

联系电话：0755-83024185/0755-83024187

邮政编码：518048

请在信封表面注明：“长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-8868-666 咨询。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下于 2018 年 12 月 20 日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金托管人经通知但拒绝到场监督，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的每份基金份额（包括久盈 A 份额与久盈 B 份额）在各自份额类别内享有同等的投票权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，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，其所代表的基金份额计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(2) 如表决意见未填、多填、表决意见模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 如表决票上的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基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之内送达基金管理人委托的公证机关的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金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：

1) 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；

2) 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决票，但计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数；

3) 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，邮寄的以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准。

六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的久盈 A 份额及久盈 B 份额基金份额持有人所代表的基金份额分别占权益登记日各自基金份额的 50%以上（含 50%）；

2、《关于长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型有关事项的议案》须经参加会议的久盈 A 份额及久盈 B 份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持分别代表久盈 A 份额及久盈 B 份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案。 基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的久盈 A 份额及久盈 B 份额基金份额持有人所代表的基金份额分别占权益登记日各自基金份额的 50%以上（含 50%）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《基金法》和《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金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基金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基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人：长城基金管理有限公司

联系地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40 层

联系电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网址：www.ccfund.com.cn

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机构：深圳市深圳公证处

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系电话：021-31358666

九、重要提示

1、请基金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。

2、本次基金份额持有人大会相关公告可通过本基金管理人网站

（www.ccfund.com.cn）查阅，投资者如有任何疑问，可致电本公司客户服务电话 400-8868-666 咨询。

3、本公告的有关内容由长城基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型方案说明书》

长城基金管理有限公司

2018年11月21日

附件一：

关于长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型有关事项的议案

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金份额持有人：

为了更好地满足广大投资者的需求，提高产品的市场竞争力，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》和《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议对长城久盈纯债分级债券型证券投资基金实施转型。长城久盈纯债分级债券型证券投资基金实施转型的具体方案详见附件四《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型方案说明书》。

为实施长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定基金转型各项工作的具体时间和方式，并根据现时有效的法律法规的要求、《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型方案说明书》和转型后开放式基金的特征，对《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上议案，请予审议。

长城基金管理有限公司

2018年11月20日

附件二：

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名或名称：

证件号码（身份证件号/营业执照号）：

基金账户号：

持有基金份额类别： 久盈 A 份额 久盈 B 份额

审议事项	同意	反对	弃权
关于长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型有关事项的议案			

基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章

2018 年 月 日

说明：

1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”。基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见未填、多填、表决意见模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数；如表决票上的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基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之内送达基金管理人委托的公证机关的，均为无效表决票，无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2、同一基金份额持有人拥有多个基金账户号且需要按照不同账户持有基金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，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的长城久盈纯债分级债券型证券投资基金全部份额（包括久盈 A 份额与久盈 B 份额）。

3、本表决票中“证件号码”，指基金份额持有人认购、申购本基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

4、本表决票可从基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）下载、从报纸上剪裁、复印

或按此格式打印。

附件三：

授权委托书（样本）

兹全权委托 先生 / 女士或 机构代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2018 年 12 月 19 日的以通讯方式召开的长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

若长城久盈纯债分级债券型证券投资基金在规定时间内重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号或营业执照注册号）：

委托人基金账户号：

受托人（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号或营业执照注册号）：

委托日期：2018 年 月 日

附注：

- 1、以上授权是基金份额持有人就其持有的长城久盈纯债分级债券型证券投资基金全部份额（包括久盈 A 份额与久盈 B 份额）向受托人所做授权。
- 2、本授权委托书中“证件号码”，指基金份额持有人认购、申购本基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。
- 3、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型方案说明书

一、声明

1、为了更好地满足广大投资者的需求，提高产品的市场竞争力，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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》

（简称“基金合同”）等有关规定，本基金管理人（长城基金管理有限公司）经与基金托管人（中国建设银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。

2、本次长城久盈纯债分级债券型证券投资基金（以下简称“长城久盈纯债分级”）转型方案须经出席会议的久盈 A 份额与久盈 B 份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持久盈 A 份额与久盈 B 份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的决议需依法报中国证监会备案，自表决通过之日起生效。中国证监会对本次长城久盈纯债分级转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型方案概要

长城久盈纯债分级转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“长城久盈纯债分级债券型证券投资基金”更名为“长城久盈纯债债券型证券投资基金”（以下简称“长城久盈纯债”或“本基金”）。

（二）取消分级运作机制

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金将取消分级运作机制。在基金份额持有人大会审议通过后，久盈 A 份额、久盈 B 份额将根据转型方案的约定全部转换为长城久盈纯债债券型证券投资基金基金份额，因而也不再设置基金份额的分级、折算、转换等机制。

（三）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，长城久盈纯债分级债券型证券投资基金将在转型正式实施前安排不少于 20 个交易日的选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、转换转出），具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

选择期期间，基金份额持有人在长城久盈纯债分级正式实施转型前，可选择赎回或转换转出久盈 A 份额、久盈 B 份额。对于在选择期内未作出上述选择的基金份额持有人，其持有的久盈 A 份额或久盈 B 份额将根据规则转换成为长城久盈纯债份额。

在选择期期间，由于久盈 A 份额、久盈 B 份额需应对赎回、转换转出等情况，基金管理人提请基金份额持有人大会审议在选择期内豁免长城久盈纯债分级基金合同中约定的投资策略、投资组合比例、份额配比等限制，并授权基金管理人据此落实相关事项及可根据实际情况做相应调整，如可暂停长城久盈纯债分级的赎回、日常转换或调整赎回、日常转换的方式及限额等。

（四）基金份额的转换业务

转型选择期届满后，基金管理人将确定份额转换日(假设该日为 T 日)，T 日日终办理长城久盈纯债分级的各类基金份额转换成长城久盈纯债基金份额。

在保持基金资产净值总额不变的前提下，久盈 A 份额、久盈 B 份额按照各自的基金份额参考净值统一转换为份额净值为 1.0000 元的长城久盈纯债份额。基金份额转换后，长城久盈纯债的份额数保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位截位，由此产生的计算误差归入基金资产。由于基金份额数采用截位法计算产生的误差，基金份额持有人将面临基金资产净值减小的风险。

份额转换计算公式如下：

久盈 A 转换后长城久盈纯债的份额数=份额转换日久盈 A 的基金份额×T 日久盈 A 的基金份额参考净值/1.0000

久盈 B 转换后长城久盈纯债的份额数=份额转换日久盈 B 的基金份额×T 日久盈 B 的基金份额参考净值/1.0000

转换后长城久盈纯债的份额净值为 1.0000 元。

（五）基金合同的生效

自久盈 A 份额、久盈 B 份额转换为长城久盈纯债份额的下一日起，《长城久盈纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》同日失效，长城久盈纯债分级债券型证券投资基金正式变更为长城久盈纯债债券型证券投资基金。

长城久盈纯债办理申购、赎回业务的时间、销售机构等具体事项将另行公告。

三、转型后“长城久盈纯债债券型证券投资基金”概要

（一）基金类别

债券型证券投资基金

(二) 运作方式

契约型、开放式

(三) 存续期限

不定期

(四) 基金的投资

1、投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金不直接参与股票、权证投资，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起 10 个交易日内卖出。

本基金的投资组合比例为：债券的投资比例不低于基金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

3、投资策略

(1) 资产配置策略

本基金采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置，主要通过对宏观经济运行周期、财政政策、货币政策、利率走势、证券市场估值水平等可能影响资本市场的重要因素进行研究和预测，分析债券市场、债券品种、现金等大类资产的预期风险和收益，动态调整基金大类资产的投资比例，以控制系统性风险。本基金将择机利用债券回购交易放大组合债券资产杠杆，在严格控制信用风险、流动性风险的基础上增强基金整体收益。

（2）债券投资策略

本基金通过综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整债券资产的平均久期及债券资产配置。本基金具体投资策略包括久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、债券回购杠杆策略等。

1) 久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。本基金的分析框架包括宏观经济指标和货币金融指标，分析金融市场中各种关联因素的变化，从而判断债券市场趋势。宏观经济指标包括 GDP、CPI、PPI、固定资产投资、进出口贸易；货币金融指标包括货币供应量、新增贷款、新增存款、超额准备金率。宏观经济指标和货币金融指标将用于估计央行货币政策，以考察央行调整利率、存款准备金率，进行公开市场操作和窗口指导等操作对市场利率的影响程度。本基金将在对市场利率变动进行充分分析的基础上，选择建立和调整最优久期固定收益类资产组合。

2) 收益率曲线策略

本基金将在确定固定收益类资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

3) 个券选择策略

在对利率产品和信用产品的资产配置上，本基金将综合对宏观周期、利率市场、行业基本面和企业基本面等方面的分析结果，考察信用产品相对利率产品的信用溢价，结合市场情绪，动态调整利率产品和信用产品的配置比例，获取超越业绩基准的超额收益。本基金将主要依托公司内部的债券信用评级系统对持有债券的信用评级进行持续跟踪，防范信用风险。

4) 可转换债券投资策略

当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资，创造超额收益。

5) 债券回购杠杆策略

本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，放大债券类资产投资比例，追求债券类资产的超额收益。

（3）中小企业私募债投资策略

与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：

①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息，分析企业的长期运作风险；②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价，评估发行人财务风险；③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率；④考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；⑤综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。

（4）资产支持证券投资策略

本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金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，以降低流动性风险。

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

4、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数收益率。

5、风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

（五）收益分配原则

本基金的收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或

将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可与基金托管人协商一致，在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应予变更实施日前在指定媒体公告。

（六）基金的费用

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、申购费用

本基金在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，适用申购费率按每笔申购申请分别计算。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下：

(1) 申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100 万元以下	0.6%
100 万元(含)－300 万元	0.4%
300 万元(含)－500 万元	0.2%
500 万元以上(含)	每笔 1000 元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。

(2) 特定申购费率

申购金额(含申购费)	特定申购费率
100 万元以下	0.12%
100 万元(含)－300 万元	0.08%
300 万元(含)－500 万元	0.04%
500 万元以上(含)	每笔 1000 元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。

如未来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

申购费用在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

4、赎回费用

本基金的赎回费率随基金份额持有时间的增加而递减，具体费率如下表所示：

持有期限 (T)	赎回费率
----------	------

T<7 天	1.5%
7≤T<30	0.1%
T≥30	0

赎回费用由赎回本基金基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，赎回费全额计入基金财产。

本基金转型前长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金份额持有人的基金份额持有期限将计入其持有本基金基金份额的持有期限。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照现时有效的法律法规的规定、根据基金份额持有人大会决议修订基金合同的内容。修订后的基金合同已经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或授权代表签章，并经中国证监会变更注册。

四、基金管理人就转型方案相关事项的说明

（一）长城久盈纯债分级债券型证券投资基金的历史沿革

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金经 2014 年 7 月 23 日中国证券监督管理委员会证监许可[2014]738 号文注册募集，基金管理人为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 10 月 28 日生效。

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金将以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，若该议案获得基金份额持有人大会通过，则基金管理人将根据基金份额持有人大会的授权，对长城久盈纯债分级债券型证券投资基金实施转型，长城久盈纯债分级债券型证券投资基金将取消分级运作机制，由分级债券型基金转型为纯债债券型基金，基金名称相应变更为“长城久盈纯债债券型证券投资基金”，长城久盈纯债分级债券型证券投资基金之久盈 A 份额及久盈 B 份额将转换为长城久盈纯债债券型证券投资基金基金份额。

（二）基金转型有利于保护份额持有人利益

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型方案是在与相关各方进行广泛沟通的基础上制定出的切实可行的方案。在过往运作中，久盈 A 份额逐步出现净赎回，取消份额分级后，份额持有人无需再关注封闭期、份额折算等情况，对投资者提供了便利性。

（三）基金转型的可行性

1、基金管理人具有丰富的基金转型运作经验，基金管理人已成功操作过基金久富转型为长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）、基金久嘉转型为长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金的封闭式基金封转开、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型为长城中证 500 指数增强型证券投资基金的工作，在基金转型上积累了较为丰富的经验。

2、基金转型不存在法律障碍

依据《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》和《基金法》的规定，转换基金运作方式须经出席会议的久盈 A 份额与久盈 B 份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持久盈 A 份额与久盈 B 份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。按照基金份额持有人大会的决议，并经中国证监会备案，基金可以转换基金运作方式。因此，长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转换为长城久盈纯债债券型证券投资基金不存在法律障碍。

3、基金转型不存在技术障碍

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型为长城久盈纯债债券型证券投资基金，转型选择期届满后将进行基金份额变更登记。基金管理人已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。因此，基金转型不存在技术障碍。

4、调整投资目标、投资范围和投资策略的可行性

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金转型之后，必须对原有基金合同中的有关内容进行修订，使其在投资目标、投资范围及其投资组合比例限制、投资策略等方面符合法律法规的规定。

5、授权基金管理人修订基金合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同。修订后的基金合同已经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或授权代表签章，并经中国证监会变更注册。

五、基金转型的主要风险及预备措施

（一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，本次份额持有人大会需要本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的久盈 A 份额与久盈 B 份额占权益登记日各自基金份额的 50%以上（含 50%）方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

（二）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

（三）基金转型开放后遭遇大规模赎回的风险

为降低部分基金份额持有人在基金开放后大量赎回对基金平稳运作的影响，本基金在转型期间将保证投资组合的流动性，以应对转型前后可能出现的较大赎回，降低净值波动率。

基金转型方案公告后，若出现基金净值剧烈波动等极端情况，基金管理人承诺将根据实际情况，加快转型进程，更早开放基金的日常赎回业务。

六、基金合同修改内容汇总

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同的具体修改内容请参见本基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）公布的《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同修订对照表》。