

## 长城证券股份有限公司

# 关于以通讯方式召开长城证券中短债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中短债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中短债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《长城证券中短债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，长城证券中短债债券型集合资产管理计划（A 类集合计划份额代码：970075，C 类集合计划份额代码：970076，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华夏银行股份有限公司（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《关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债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“长城证券中短债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《关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债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《关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债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](http://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“长城证券中短债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代其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](http://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（华夏银行股份有限公司）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：《关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债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](http://www.cgws.com)

2、集合计划托管人：华夏银行股份有限公司

住 所：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

联系电话：010-85238309

网址：<https://www.hxb.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](http://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：关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债债券型证券投资基金有关事项的议案

附件二：长城证券中短债债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决票

附件三：长城证券中短债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：关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债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：

## 关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债债券型证券投资基金有关事项的议案

长城证券中短债债券型集合资产管理计划份额持有人：

长城证券中短债债券型集合资产管理计划（集合计划份额代码：970075，C类集合计划份额代码：970076，以下简称“本集合计划”）经中国证监会2021年9月2日《关于准予长城季季红1号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]2787号），由长城季季红1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”），集合计划托管人为华夏银行股份有限公司。《长城证券中短债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10月26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生效日起存续期不得超过3年”。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，长城证券中短债债券型集合资产管理计划拟相应变更为长城中短债债券型证券投资基金，并调整产品类别、产品期限、登记机构、投资策略、投资限制等并修订合同。

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	长城证券中短债债券型集合资产管理计划	长城中短债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
投资策略		调整“信用债投资策略”为“信用债(含资产支持证券)投资策略”，并补充“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。”，同步删除原资产支持证券投资策略。
投资限制	--	删除“本集合计划应投资于信用评级为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”； 删除“本集合计划进入全国银行

		<p>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，且进行债券回购的资金余额不得超过本集合计划净资产的 40%”；</p> <p>删除“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：</p> <p>1) 本集合计划投资于 AAA 信用等级的信用债的比例占信用债资产的 50%-100%；</p> <p>2) 本集合计划投资于 AA+信用等级的信用债的比例占信用债资产的 0%-50%。</p> <p>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。其中短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级执行”。</p>
--	--	---

具体修改内容和程序详见《关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债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。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：

长城证券中短债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
《关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债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			
年 月 日			
<p>说明：</p> <p>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。</p> <p>“基金账户号”仅指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。</p>			

（本表决票可剪报、复印或登录集合计划管理人网站（[www.cgws.com](http://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：

## 长城证券中短债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\_\_日的长城证券中短债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。若长城证券中短债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中短债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中短债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](http://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：

**关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划  
更换管理人并变更注册为长城中短债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生效之日起存续期不得超过3年”。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《长城证券中短债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华夏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《关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债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，长城证券中短债债券型集合资产管理计划拟相应变更为长城中短债债券型证券投资基金，并调整产品类别、产品期限、登记机构、投资策略、投资限制等并修订合同。

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	长城证券中短债债券型集合资产管理计划	长城中短债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
投资策略		调整“信用债投资策略”为“信用债(含资产支持证券)投资策略”，并补充“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。”，同步删除原资产支持证券投资策略。
投资限制	--	删除“本集合计划应投资于信用

		<p>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”；</p> <p>删除“本集合计划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，且进行债券回购的资金余额不得超过本集合计划净资产的 40%”；</p> <p>删除“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：</p> <p>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%；</p> <p>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%。</p> <p>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。其中短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级执行”。</p>
--	--	---

除上述内容的调整需要修改《集合计划合同》以外，集合计划管理人根据法律法规更新、集合计划托管人信息更新、变更后的基金特点对《集合计划合同》的其他相关内容进行必要修订，具体修改内容请详见附件《集合计划合同修改前后对照表》。

集合计划管理人将根据修订后的《长城中短债债券型证券投资基金基金合同》相应修订托管协议、招募说明书等法律文件。

本集合计划将于本次集合计划份额持有人大会决议生效后启动办理变更管理人以及修改《集合计划合同》的相关交接手续。长城基金管理有限公司将另行发布相关公告。

### **三、变更特别开放期的相关安排**

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。对于在特别开放期内未赎回的份额持有人，其持有的集合计划份额将在《长城中短债债券型证券投资基金基金合同》生效后自动变更为长城中短债债券型证券投资基金相应类别的基金份额。

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。集合计划管理人提请份额持有人大会授权集合计划管理人据此落实相关事项，并授权集合计划管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况暂停申购、赎回等，暂停申购、赎回的具体安排以后续公告为准。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。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

### **四、份额持有人基金账户的开立**

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。

## 五、修改方案可行性

### （一）法律层面

《基金法》第四十七条规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：……（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同；（三）决定更换基金管理人、基金托管人……”。第八十六条规定，“……转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。”

根据《运作办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

因此，本次份额持有人大会审议事项属于特别决议，需经参加大会的份额持有人或其代理人所持表决票的三分之二以上(含三分之二)通过，决议方可生效。本次变更管理人以及修改资产管理合同有关事项的事宜符合相关法律法规要求，修订方案不存在法律层面上的障碍。

### （二）技术层面

为了保障本次持有人大会的顺利召开，集合计划管理人成立了工作小组，筹备、执行持有人大会相关事宜。集合计划管理人与投资者进行了充分沟通，保证持有人大会可以顺利召开。本次持有人大会决议生效并公告后，长城基金管理有限公司将公告修订后的基金合同及托管协议，并在法律法规规定的时间内更新招募说明书。集合计划管理人、集合计划托管人已就本集合计划变更有关事项进行了充分沟通和细致准备，技术可行。因此，变更注册方案不存在运营技术层面的障碍。

## 六、方案的主要风险及预备措施

### （一）集合计划份额持有人大会不能成功召集或方案被否决的风险

根据《基金法》的相关规定及资产管理合同的相关约定，本次大会召开需满足“本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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）”的召集成功条件，以及“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”的表决通过条件。

为防范出现大会不能成功召集或方案被否决的风险，在提议修改资产管理合同并设计具体方案之前，集合计划管理人拟定议案综合考虑了集合计划份额持有人的要求。如有必要，集合计划管理人将根据集合计划份额持有人意见，对资产管理合同变更方案进行适当修订，并重新公告。集合计划管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟集合计划份额持有人大会的召开的充分准备。如果本次议案未获得集合计划份额持有人大会通过，集合计划管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向集合计划份额持有人大会提交本次议案。

### （二）集合计划持有人集中赎回集合计划份额的流动性风险及预备措施

在会议召开通知公告后，部分集合计划份额持有人可能选择赎回其持有的集合计划份额。集合计划管理人将提前做好流动性安排，保持投资组合流动性，以应对可能发生的规模赎回对基金运作的影响，尽可能降低净值波动率。

附件：《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后对照表

## 《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后对照表

章节	《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》 条款	《长城中短债债券型证券投资基金 基金合同（草案）》条款
管理人	长城证券股份有限公司	长城基金管理有限公司
全文	长城证券中短债债券型集合资产管理计划	长城中短债债券型证券投资基金
全文	管理人	基金管理人
全文	托管人	基金托管人
全文	集合计划份额持有人	基金份额持有人
全文	份额	基金份额
全文	计划、集合计划、本集合计划、集合资产管理计划	基金、本基金、证券投资基金
全文	本合同、资产管理合同、本资产管理合同、《资产管理合 同》、集合资产管理计划资产管理合同	基金合同、《基金合同》、本基金合同
全文	托管协议	基金托管协议
全文	招募说明书	基金招募说明书
全文	产品资料概要	基金产品资料概要

<p><b>第一部分 前言</b></p>	<p>一、订立本合同的目的、依据和原则</p> <p>1、订立本合同的目的是保护投资人合法权益，明确集合资产管理计划资产管理合同当事人的权利义务，规范长城证券中短债债券型集合资产管理计划运作。</p> <p>2、订立本合同的依据是《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》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券公司大集合资产管理业务适用&lt;关于规范金融机构资产管理业务的指导意见&gt;操作指引》和其他有关法律法规。</p> <p>二、集合资产管理计划资产管理合同(以下简称“资产管理合同”或“本合同”)是规定资产管理合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与集合资产管理计划相关的涉及资产管理合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表</p>	<p>一、订立基金合同的目的、依据和原则</p> <p>1、订立基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。</p> <p>2、订立基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。</p> <p>二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金</p>
-----------------------	--	---



	<p>述，如与资产管理合同有冲突，均以资产管理合同为准。资产管理合同当事人按照《基金法》、资产管理合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>资产管理合同的当事人包括集合资产管理计划管理人（以下简称“管理人”）、集合资产管理计划托管人（以下简称“托管人”）和集合资产管理计划份额持有人（以下简称“集合资产管理计划份额持有人”）。集合资产管理计划投资人自依本合同取得集合资产管理计划份额，即成为集合计划份额持有人和本合同的当事人，其持有集合资产管理计划份额的行为本身即表明其对资产管理合同的承认和接受。</p> <p>三、长城证券中短债债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）由长城季季红 1 号集合资产管理计划变更而来。长城季季红 1 号集合资产管理计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务管理办法》（证监会令第 87 号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告〔2012〕29 号）、《长城季季红 1 号集合资产管理合同》及其他有关规定募集设立。</p>	<p>合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。</p> <p>三、长城中短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由长城证券中短债债券型集合资产管理计划变更注册而来。长城证券中短债债券型集合资产管理计划由长城季季红 1 号集合资产管理计划变更而来。长城季季红 1 号集合资产管理计划由长城证券股份有限公司依照《证券公司客户资产管理业务管理办法》（证监会令第 87 号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告〔2012〕29 号）、</p>
--	---	--

	<p>中国证监会对长城季季红 1 号集合资产管理计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。</p>	<p>《长城季季红 1 号集合资产管理合同》及其他有关规定募集设立。</p> <p>中国证监会对长城季季红 1 号集合资产管理计划变更为长城证券中短债债券型集合资产管理计划、长城证券中短债债券型集合资产管理计划变更为本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p> <p>七、对于投资者依据《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的长城证券中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金 A 类基金份额。</p> <p>对于投资者依据《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的长城证券中短债债券型集合资产管理计划 C 类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金 C 类基金份额。</p> <p>八、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体</p>
--	---	--

		<p>详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的风险。</p>
<p><b>第二部分 释义</b></p>	<p>1、集合资产管理计划：指长城证券股份有限公司设立管理的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划</p> <p>16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会</p> <p>20、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</p> <p>23、集合计划销售业务：指管理人或销售机构宣传推介集合计划，办理集合计划份额的申购、赎回、转换、转托管等业务</p> <p>26、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登</p>	<p>15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局</p> <p>19、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</p> <p>22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</p> <p>25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机</p>

	<p>记机构为中国证券登记结算有限公司</p> <p>28、集合计划交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回等业务而引起的集合计划份额变动及结余情况的账户</p> <p>29、资产管理合同生效日：指《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，《长城季季红1号集合资产管理合同》同日失效</p> <p>31、存续期：指《长城季季红1号集合资产管理合同》生效至本合同终止之间的期限</p> <p>32、工作日/交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日</p> <p>37、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其不时做出的修订，是规范管理人所管理的并由中国证券登记结算有限责任公司办理登记业务的集合资产管理计划登记方面的业务规则</p>	<p>构为长城基金管理有限公司或接受长城基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构</p> <p>27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>28、基金合同生效日：指《长城中短债债券型证券投资基金基金合同》生效之日，《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日失效</p> <p>30、存续期：指《长城季季红1号集合资产管理合同》生效至本基金合同终止之间的不定期期限</p> <p>31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日</p> <p>36、《业务规则》：指《长城基金管理有限公司开放式证券投资基金注册登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守</p> <p>41、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提</p>
--	--	--

	<p>44、集合计划收益：指集合计划投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用集合计划财产带来的成本和费用的节约</p> <p>45、集合计划资产总值：指集合计划拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、集合计划应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>50、A 类份额：指依据本资产管理合同，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额；对于投资者依据《长城季季红 1 号集合资产管理合同》参与原集合计划获得的长城季季红 1 号集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 A 类份额</p> <p>51、C 类份额：指依据本资产管理合同，在投资者申购</p>	<p>出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式</p> <p>44、基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>45、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、票据价值、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>50、A 类基金份额：指依据本基金合同，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p>对于投资者依据《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的长城证券中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金 A 类基金份额</p> <p>51、C 类基金份额：指依据本基金合同，在投资者申购</p>
--	--	---

	<p>时不收取申购费，在赎回时收取赎回费，但从本类别计划资产中计提销售服务费的份额</p> <p>52、销售服务费：指从集合计划财产中计提的，用于本集合计划市场推广、销售以及集合计划份额持有人服务的费用</p> <p>57、不可抗力：指本资产管理合同当事人不能预见、不能避免且不能克服、使《资产管理合同》当事人无法全部或部分履行《资产管理合同》的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易</p>	<p>时不收取申购费，在赎回时收取赎回费，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p>对于投资者依据《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的长城证券中短债债券型集合资产管理计划 C 类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金 C 类基金份额</p> <p>52、销售服务费：指从 C 类基金份额的基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用</p> <p>57、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件</p>
<p><b>第三部分 基金的基本情况</b></p>	<p>三、集合计划的运作方式</p> <p>契约型开放式</p>	<p>三、基金的运作方式</p> <p>契约型开放式</p>

	<p>对于投资者依据《长城季季红1号集合资产管理合同》参与原集合计划获得的长城季季红1号集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划A类份额。</p> <p>本集合计划A类、C类份额每个开放日开放申购、赎回。</p> <p>六、集合计划存续期限</p> <p>本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续至2025年4月25日，存续期限届满后，按照中国证监会有关规定执行。</p> <p>七、集合计划份额类别设置</p> <p>A类份额：指依据本资产管理合同，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额。对于投资者依据《长城季季红1号集合资产管理合同》参与原集合计划获得的长城季季红1号集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划A类份额。</p> <p>C类份额：指依据本资产管理合同，在投资者申购时不收取申购费，在赎回时收取赎回费，但从本类别计划资产中计</p>	<p>六、基金存续期限</p> <p>不定期。</p> <p>七、基金份额类别设置</p> <p>A类基金份额：指依据本基金合同，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。对于投资者依据《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的长城证券中短债债券型集合资产管理计划A类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金A类基金份额。</p> <p>C类基金份额：指依据本基金合同，在投资者申购时不收取申购费，在赎回时收取赎回费，但从本类别基金资产中计</p>
--	---	--

	<p>提销售服务费的份额。</p> <p>各类份额净值的计算公式为：</p> <p>T 日某类集合计划份额净值 = T 日该类集合计划份额的资产净值 / T 日该类集合计划份额余额总数。本集合计划不同份额类别之间不得互相转换。</p>	<p>提销售服务费的基金份额。对于投资者依据《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的长城证券中短债债券型集合资产管理计划C类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金C类基金份额。</p> <p>各类份额净值的计算公式为：</p> <p>T日某类基金份额净值 = T日该类基金份额的资产净值 / T日该类基金份额余额总数。</p>
<p><b>第四部分 基金的历史沿革</b></p>	<p>长城证券中短债债券型集合资产管理计划由长城季季红1号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。</p> <p>原集合计划为限定性集合资产管理计划，由长城证券股份有限公司发起设立，自2013年4月1日开始募集并于2013年4月10日结束募集，于2013年4月12日成立。该计划于2013年5月31日获得中国证券业协会备案函《关于长城证券有限责任公司发起设立长城季季红1号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]469号）。</p>	<p>长城中短债债券型证券投资基金由长城证券中短债债券型集合资产管理计划变更而来。长城证券中短债债券型集合资产管理计划由长城季季红1号集合资产管理计划变更而来。</p> <p>长城季季红1号集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，管理人为长城证券股份有限公司，托管人为华夏银行股份有限公司，自2013年4月1日开始募集并于2013年4月10日结束募集，于2013年4月12日成立。该计划于2013年5月31日获得中国证券业协会备案函《关于长城证券有限责任公司发起设立长城季季红1号集合资产管理计划的备案确认函》</p>



	<p>根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用&lt;关于规范金融机构资产管理业务的指导意见&gt;操作指引》（证监会公告〔2018〕39号）的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。</p> <p>经中国证监会批准，《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公告的生效之日起生效，《长城季季红1号集合资产管理合同》同日起失效。</p>	<p>（中证协函[2013]469号）。</p> <p>根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用&lt;关于规范金融机构资产管理业务的指导意见&gt;操作指引》（证监会公告〔2018〕39号）的规定，经中国证监会批准，长城季季红1号集合资产管理计划变更为长城证券中短债债券型集合资产管理计划，《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》自2021年10月26日起生效，《长城季季红1号集合资产管理合同》同日起失效。</p> <p>根据《基金法》、《运作办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用&lt;关于规范金融机构资产管理业务的指导意见&gt;操作指引》等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，长城证券中短债债券型集合资产管理计划经中国证监会2025年1月20日证监许可【2025】102号文准予变更注册。</p> <p>长城证券中短债债券型集合资产管理计划以通讯方式召开集合计划份额持有人大会，并于2025年 月 日表决通过了《关于长城证券中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为长城中短债债券型证券投资基金有关事项的议</p>
--	---	---

		<p>案》，同意长城证券中短债债券型集合资产管理计划变更注册为公募基金并变更管理人、调整登记机构、调整产品名称、产品的类别、存续期限、投资策略、投资限制等并修订合同等。集合计划份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。</p> <p>自2025年 月 日起,《长城中短债债券型证券投资基金基金合同》生效,《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。长城证券中短债债券型集合资产管理计划变更为长城中短债债券型证券投资基金,即本基金。</p>
<p><b>第五部分 基金的存续</b></p>	<p>资产管理合同生效后,连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的,管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他集合资产管理计划合并或者终止资产管理合同等,并在6个月内召集集合计划份额持有人大会进行表决。</p> <p>本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续至2025年</p>	<p>基金合同生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会。</p>

	4月25日，存续期限届满后，按照中国证监会有关规定执行。	
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本集合计划的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由管理人在招募说明书或其网站列明。管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。集合计划投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的申购与赎回。</p> <p>若管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行集合计划份额的申购与赎回。具体办法由管理人或指定的销售机构另行公告。</p> <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>管理人可根据实际情况依法决定本集合计划开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>A类、C类份额每个开放日开放申购、赎回业务。</p> <p>管理人不得在资产管理合同约定之外的日期或者时间办</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其网站公示。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p> <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金合同生效后，基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购、赎回的具体日期，具体业务办理时间在相关公告中规定。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办</p>

<p>理集合计划份额的申购、赎回或者转换。投资人在资产管理合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其集合计划份额申购、赎回或转换价格为下一开放日集合计划份额申购、赎回或转换的价格。</p> <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算。</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回。集合计划份额持有人持有原长城季季红 1 号集合资产管理计划的份额期限自本资产管理合同生效之日起重新计算。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或</p>	<p>理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。</p> <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金份额净值为基准进行计算。</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人持有基金份额登记日期的先后次序进行顺序赎回。各类基金份额持有人持有原长城证券中短债债券型集合资产管理计划相应份额的期限分别连续计算。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日 (T 日)，在正常情况下，登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网</p>
--	---

	<p>以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项（不含息）退还给投资人。管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上提前公告。</p> <p>集计划销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>	<p>点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项（不含息）退还给投资人。</p> <p>基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。</p> <p>基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上提前公告。</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>5、基金管理人可以规定本基金的总规模限额、单个投资人单日/单笔申购金额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p>
--	---	--

	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本集合计划各类份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。</p> <p>5、赎回费用由赎回集合计划份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。赎回费用归入集合计划财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书及产品资料概要的规定，未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并全额计入集合计划财产。</p> <p>6、投资者申购本集合计划A类份额需缴纳申购费，C类份额不收取申购费用。本集合计划A类份额的申购费率、各</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金各类基金份额分别设置代码，分别计算各类基金份额净值和各类基金份额累计净值并单独公告。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。</p> <p>5、赎回费用由赎回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。赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。</p> <p>6、投资者申购本基金A类基金份额需缴纳申购费，C类基金份额不收取申购费用。本基金A类基金份额的申购费率、</p>
--	--	---

	<p>类份额申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由管理人根据资产管理合同的规定确定，并在招募说明书及产品资料概要中列示。管理人可以在资产管理合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p> <p>8、管理人可以在不违反法律法规规定及资产管理合同约定且对存量集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定集合计划促销计划，定期或不定期地开展集合计划促销活动。在集合计划促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，管理人可以适当调低集合计划销售费用，并进行公告。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>各类基金份额申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p> <p>8、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对存量基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费用。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>8、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>9、当日申购申请超出基金管理人规定的总规模限制、单</p>
--	--	--

	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、8 项暂停申购情形之一且管理人决定暂停接受投资人申购申请时，管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7 项情形时，管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝部分的申购款项（不含息）将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，管理人应及时恢复申购业务的办理。管理人有权合理调整申购业务的办理期间并予以公告。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，</p>	<p>日净申购比例上限、单个投资人单日/单笔申购金额上限、单个投资人累计持有份额上限的情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7、9 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝部分的申购款项（不含息）将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第</p>
--	--	---



<p>按资产管理合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当集合计划出现巨额赎回时，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(3) 如发生单个开放日内单个集合计划份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一开放日的集合计划总份额的20%时，管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出20%以上的部分赎回申请实施延期办理，管理人只接受其集合计划总份额20%部分作为当日有效赎回申请，即对该单个集合计划份额持有人20%以内(含20%)的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”条款处理，对单个集合计划份额持有人超过集合计划总份额20%以上的赎回申请延期赎回。延期的赎回申请与</p>	<p>4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。</p> <p>(3) 如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的20%时，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出20%以上的部分赎回申请实施延期办理，基金管理人只接受其基金总份额20%部分作为当日有效赎回申请，即对该单个基金份额持有人20%以内(含20%)的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”条款处理。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金</p>
--	--

	<p>下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>十四、集合计划的冻结和解冻</p> <p>登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。集合计划账户或集合计划份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付，法律法规另有规定的除外。</p>	<p>额，以此类推，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>十四、基金份额的冻结和解冻</p> <p>登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配，法律法规或监管机构另有规定的除外。</p> <p>十七、定期定额投资计划</p> <p>基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定</p>
--	--	---

	<p>十七、其他业务</p> <p>在相关法律法规允许的条件下，集合计划登记机构可依据其业务规则，受理集合计划份额质押等业务，并收取一定的手续费用。</p>	<p>额投资计划最低申购金额。</p> <p>十八、其他业务</p> <p>在相关法律法规允许的条件下，基金管理人可制定和实施相应的业务规则，办理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。</p>
<p><b>第七部分 基金合同</b></p> <p><b>当事人及权利义务</b></p>	<p>一、管理人</p> <p>(一) 管理人简况</p> <p>住所：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层</p> <p>法定代表人：王军</p> <p>设立日期：1996 年 5 月 2 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行深圳经济特区分行《关于同意成立长城证券有限责任公司的批复》（深人银复字[1995]第 339 号）</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：403,442.6956 万人民币</p> <p>联系电话：400-6666-888</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层</p> <p>法定代表人：王军</p> <p>设立日期：2001 年 12 月 27 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：人民币壹亿伍仟万元</p> <p>联系电话：0755-29279188</p>

	<p>(二) 管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(12) 依照法律法规为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；</p> <p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(2) 办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续；</p> <p>(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；</p> <p>(12) 保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，</p>	<p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；</p> <p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资和非交易过户的业务规则；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(2) 办理基金备案手续；</p> <p>(10) 编制基金季度报告、中期报告和年度报告；</p> <p>(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但</p>
--	---	---

	<p>不向他人泄露；</p> <p>二、托管人</p> <p>(二) 托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：</p> <p>(4) 根据相关市场规则，为集合计划开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为集合计划办理证券交易资金清算；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(2) 设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜；</p> <p>(7) 保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；</p>	<p>法律法规另有规定，或监管机构、有权机关另有要求，或交易所要求披露，以及审计、法律等外部专业顾问依法要求提供的除外；</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为基金办理证券/期货交易资金清算；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；</p> <p>(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但法律法规另有规定，或监管机构、有权</p>
--	---	--

	(8) 复核、审查管理人计算的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购、赎回价格;	机关另有要求, 或交易所要求披露, 以及审计、法律等外部专业顾问依法要求提供的除外; (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格;
<b>第八部分 基金份额持有人大会</b>	<p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的, 应当召开集合计划份额持有人大会, 但法律法规另有规定的除外:</p> <p>2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下, 以下情况可由管理人和托管人协商后修改, 不需召开集合计划份额持有人大会:</p> <p>(5) 管理人、登记机构、销售机构调整有关申购、赎回、转换、集合计划份额交易、非交易过户、转托管、集合计划份额转让等业务规则;</p> <p>(6) 管理人将本合同及托管协议项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司;</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规、监管机构或基金合同另有规定外, 当出现或需要决定下列事由之一的, 应当召开基金份额持有人大会:</p> <p>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下, 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改, 不需召开基金份额持有人大会:</p> <p>(5) 基金管理人、登记机构、销售机构调整有关申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则;</p> <p>(6) 本基金在履行适当程序后推出新业务或服务;</p>

	<p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。</p> <p>三、召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。</p> <p>3、如召集人为管理人，还应另行书面通知托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为托管人，则应另行书面通知管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为集合计划份额持有人，则应另行书面通知管理人和托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。管理人或托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。</p> <p>四、集合计划份额持有人出席会议的方式</p>	<p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。</p> <p>三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。</p> <p>3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。</p> <p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p>
--	--	--

	<p>2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或资产管理合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或资产管理合同约定的其他方式进行表决。</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>(2) 召集人按资产管理合同约定通知托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取集合计划份额持有人的书面表决意见；托管人或管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；</p> <p>(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见集合计划份额持有人所持有的集合计划份额小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一，召集人可以在原公告的集合计划份额</p>	<p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；</p> <p>(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集</p>
--	--	--



	<p>持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项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有代表三分之一以上（含三分之一）集合计划份额的集合计划份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；</p> <p>（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并与集合计划登记机构记录相符。</p> <p>六、表决</p> <p>采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的集合计划份</p>	<p>人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；</p> <p>（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。</p> <p>六、表决</p> <p>采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人</p>
--	--	--

	<p>额持有人所代表的集合计划份额总数。</p> <p>七、计票</p> <p>2、通讯开会</p> <p>在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在托管人授权代表（若由托管人召集，则为管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。管理人或托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。</p> <p>九、实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定</p> <p>3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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相关集合计划份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>十、本部分关于集合计划份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部</p>	<p>所代表的基金份额总数。</p> <p>七、计票</p> <p>2、通讯开会</p> <p>在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金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。</p> <p>九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</p> <p>3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>十、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并</p>
--	---	---

	分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。	履行适当程序后，可直接对本部分内容进行相应修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。
<b>第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</b>	<p>二、管理人和托管人的更换程序</p> <p>(一) 管理人的更换程序</p> <p>2、决议：集合计划份额持有人大会在管理人职责终止后6个月内对被提名的管理人形成决议，该决议需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）表决通过，决议自表决通过之日起生效。</p> <p>(二) 托管人的更换程序</p> <p>2、决议：集合计划份额持有人大会在托管人职责终止后6个月内对被提名的托管人形成决议，该决议需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）表决通过，决议自表决通过之日起生效。</p> <p>(四) 管理人更换的特殊程序</p> <p>当管理人根据相关法律法规的规定，以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司时，在管理人和托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同及</p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一) 基金管理人的更换程序</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效。</p> <p>(二) 基金托管人的更换程序</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效。</p>

	<p>托管协议中管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的公司，本集合计划的管理人变更为前述从事资产管理业务的公司。前述变更事项无需召开集合计划份额持有人大会审议。</p> <p>三、新任或临时管理人接收集合计划管理业务前或新任或临时托管人接收集合计划财产和集合计划托管业务前，原任管理人或原任托管人应依据法律法规和《资产管理合同》的规定继续履行相关职责，并保证不对集合计划份额持有人的利益造成损害。原任管理人或原任托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的规定收取集合计划管理费、集合计划托管费或销售服务费。</p> <p>四、本部分关于管理人、托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。</p>	<p>三、新任或临时基金管理人接收基金管理业务前或新任或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原任基金管理人或原任基金托管人应依据法律法规和《基金合同》的规定继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。原任基金管理人或原任基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照基金合同的规定收取基金管理费、基金托管费或销售服务费。</p> <p>四、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人或基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
--	--	---

<p><b>第十一部分 基金份额的登记</b></p>	<p>二、集合计划登记业务办理机构</p> <p>本集合计划的登记业务由管理人委托的其他符合条件的机构办理。管理人委托其他机构办理本集合计划登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确管理人和代理机构在投资者集合计划账户管理、集合计划份额登记、清算及集合计划交易确认、发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册和办理非交易过户等事宜中的权利和义务，保护集合计划份额持有人的合法权益。</p>	<p>二、基金登记业务办理机构</p> <p>本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	<p>二、投资范围</p> <p>本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持机构债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、由中国证监会批准在中国金融期货交易所上市交易的以国债为标的的金融期货合约（以下简称“国债期货”）以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持机构债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货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）。</p>

	<p>证监会相关规定)。</p> <p>本集合计划不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。</p> <p>本集合计划所指的中短期债券是指剩余期限或回售期限不超过3年(含)的债券资产，主要包括国债、中央票据、金融债券、政府支持机构债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。</p> <p>三、投资策略</p> <p>(一) 固定收益品种投资策略</p> <p>“核心存量资产”为组合的主要部分，买入并战略性持有中短期限的国债、金融债、信用债等，确保总体组合取得一定的收益。核心资产投资主要采取买入持有策略，在稳定投资组合收益率、锁定下行风险方面起到重要作用。</p> <p>在核心存量资产保证投资策略稳定的同时，根据市场和风险情况，灵活配置一部分为战术交易资产，采用多种固定收益投资策略，对流动性较高的债券资产进行交易，在严格</p>	<p>本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。</p> <p>本基金所指的中短期债券是指剩余期限或回售期限不超过3年(含)的债券资产，主要包括国债、央行票据、金融债券、政府支持机构债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。</p> <p>三、投资策略</p> <p>(一) 固定收益品种投资策略</p> <p>“核心存量资产”为组合的主要部分，买入并战略性持有中短期限的国债、金融债、信用债等，以期总体组合取得一定的收益。核心资产投资主要采取买入持有策略，在稳定投资组合收益率、锁定下行风险方面起到重要作用。</p> <p>在核心存量资产保证投资策略稳定的同时，根据市场和风险情况，灵活配置一部分为战术交易资产，采用多种固定收益投资策略，对流动性较高的债券资产进行交易，力争在</p>
--	---	---

	<p>控制下行风险的基础上获得增值收益。交易性资产选择以流动性良好为首要原则, 另外还要为投资提供积极管理的机会。战略资产与战术交易资产比例根据各种类别固定收益投资工具的预期收益率和波动性来确定, 用风险预算的原理保障使组合有很大的把握达到一定的最低收益水平。其中核心资产采用战略性持有策略, 主要在选择市场切入点上追求增值, 在利率走势无方向性变化时基本持有到期, 可以不考虑收益率的波动性。</p> <p>债券组合管理的策略应该是多元化的, 其中心是在保持风险在相对低的情况下从全方位的债券投资策略中选取最优的投资想法, 其中包括利率方向性判断、相对价值判断、信用利差分析的合理运用。其中主要包括:</p> <p>1、买入持有策略</p> <p>以简单、低成本为原则, 挑选符合投资目标要求的债券买入持有, 并在到期后滚动投资于新发行的符合目标要求的债券。对执行买入持有策略的债券, 应根据评估持有期的总回报水平评估能否满足组合在货币市场投资上的长期期望收</p>	<p>严格控制下行风险的基础上获得增值收益。交易性资产选择以流动性良好为首要原则, 另外还要为投资提供积极管理的机会。战略资产与战术交易资产比例根据各种类别固定收益投资工具的预期收益率和波动性来确定, 用风险预算的原理以期组合有较大把握达到一定的收益水平。其中核心资产采用战略性持有策略, 主要在选择市场切入点上追求增值, 在利率走势无方向性变化时基本持有到期。</p> <p>债券组合管理的策略多元化, 其中心是在保持风险在相对低的情况下从全方位的债券投资策略中选取最优的投资想法, 其中包括利率方向性判断、相对价值判断、信用利差分析的合理运用。其中主要包括:</p> <p>1、买入持有策略</p> <p>以简单、低成本为原则, 挑选符合投资目标要求的债券买入持有, 并在到期后滚动投资于新发行的符合目标要求的债券。对执行买入持有策略的债券, 根据评估持有期的总回报水平评估能否满足组合在货币市场投资上的长期期望收益</p>
--	--	--

	<p>益率。</p> <p>2、债券类属配置策略</p> <p>根据国债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。</p> <p>5、信用债投资策略</p> <p>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。其中短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级执行。</p> <p>6、收益率曲线策略</p> <p>在确定组合或类属久期后，进一步确定同一债券发行者不同期限债券的相对价值。确定采用哑铃型策略、梯形策略和子弹型策略等，在不同期限债券间进行配置，以从其相对价格变化中获利。</p> <p>（二）资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将对基础资产质量、主体资质、未来现金流、</p>	<p>率。</p> <p>2、债券类属配置策略</p> <p>根据国债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，争取取得较高收益。</p> <p>5、信用债（含资产支持证券，下同）投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、收益率曲线策略</p> <p>在确定组合或类属久期后，进一步确定同一债券发行者</p>
--	---	---



	<p>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。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>集合计划的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(4) 本管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制；</p> <p>(8) 本管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划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%；</p> <p>(9) 本集合计划应投资于信用级别评级为 <b>BBB</b> 以上(含 <b>BBB</b>) 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；</p>	<p>不同期限债券的相对价值。确定采用哑铃型策略、梯形策略和子弹型策略等，在不同期限债券间进行配置，以期从其相对价格变化中获利。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；</p> <p>(8) 本基金管理人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，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p>
--	---	---

	<p>(10) 本集合计划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，且进行债券回购的资金余额不得超过本集合计划净资产的 40%；</p> <p>(12) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的 15%，且不得投资于流通受限证券；因证券市场波动、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(15) 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：</p> <p>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%；</p> <p>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%。</p> <p>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。其中短期融资券、超短期融资券等短期信用</p>	<p>(10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p>
--	--	--

	<p>债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级执行。</p> <p>除上述 (2)、(9)、(12)、(13) 情形之外, 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的, 管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本集合计划, 管理人在履行适当程序后, 则本集合计划投资不再受相关限制。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护集合计划份额持有人的合法权益, 集合计划财产不得用于下列投资或者活动:</p> <p>(4) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;</p> <p>管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的,</p>	<p>除上述 (2)、(10)、(11) 情形之外, 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。</p> <p>法律法规或监管部门取消或变更上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:</p> <p>(4) 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;</p> <p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关</p>
--	---	--

	<p>应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，管理人在履行适当程序后，本集合计划可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定为准。经与托管人协商一致，管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对资产管理合同进行变更，该变更无须召开集合计划份额持有人大会审议。</p> <p>五、业绩比较基准</p>	<p>关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权</p>
--	---	--

	<p>六、风险收益特征</p> <p>本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划，高于货币市场基金。</p> <p>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护集合计划份额持有人利益的原则，管理人经与托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及资产管理合同的约定启用侧袋机制。</p>	<p>益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，基金管理人应在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上刊登公告，无需召开基金份额持有人大会审议。</p> <p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。</p> <p>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
<p>第十三部分 基金的财产</p>	<p>一、集合计划资产总值</p> <p>集合计划资产总值是指集合计划拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和集合计划应收款项以及其他投资所形</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类证券、票据价值、银行存款本息和基金应收款项以及其他投资所形成的价值总</p>

	成的价值总和。	和。
第十四部分 基金资产估值	<p>四、估值方法</p> <p>1、在证券交易所市场流通的证券,按如下估值方式处理:</p> <p>(1)交易所上市的有价证券,以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;</p> <p>(2)交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(本资产管理合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值;</p> <p>(3)交易所上市交易的可转换债券、可交换债券,以估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值(如为净价交易则以收盘价作为估值净价,下同);</p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(另有规定的除外),选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值;</p> <p>(2)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种(另有规定的除外),选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值;</p> <p>(3)交易所含投资者回售权的固定收益品种,行使回售权的,在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进</p>

	<p>估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。</p> <p>(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。</p> <p>2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允</p>	<p>行估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响；回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值；</p> <p>(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p>
--	--	---

	<p>价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p> <p>5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估</p>	<p>(1) 首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值；</p> <p>(2) 对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</p> <p>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种（另有规定的除外），按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对全国银行间市场上含权的固定收益品种（另有规定的除外），按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对于全国银行间市场上含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对于全国银行间市场未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的</p>
--	--	---



<p>值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。</p> <p>根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。</p> <p>五、估值程序</p> <p>1、各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按规定对外公布。</p>	<p>估值技术确定其公允价值。</p> <p>根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的基金会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。</p> <p>五、估值程序</p> <p>1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。</p>
---	--

	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>4、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。</p> <p>八、集合计划净值的确认</p> <p>集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人按规定对集合计划净值予以公布。</p> <p>九、特殊情形的处理</p> <p>1、管理人、托管人按估值方法的第9项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、证券/期货经纪机构及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> <p>八、基金净值的确认</p> <p>基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值予以公布。</p> <p>九、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人、基金托管人按估值方法的第8项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、证券/期货经纪机构及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。</p>
--	---	---

	<p>管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>	<p>但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>
<p><b>第十五部分 基金费用与 税收</b></p>	<p>一、集合计划费用的种类</p> <p>3、销售服务费；</p> <p>4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；</p> <p>二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、管理人的管理费</p> <p>本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $G = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ <p>G 为每日应计提的集合计划管理费</p> <p>集合计划管理费每日计算，逐日累计至每季度末，按季支付，由管理人于次一季度前 5 个工作日内向托管人发送集合计划管理费划款指令，托管人复核后从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>3、C 类基金份额的销售服务费；</p> <p>4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p>

	<p>2、托管人的托管费</p> <p>本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.1% 年费率计提，计算方法如下：</p> $T = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ <p>T 为每日应计提的集合计划托管费</p> <p>集合计划托管费每日计算，逐日累计至每季度末，按季支付，由管理人于次一季度前 5 个工作日内向托管人发送集合计划托管费划款指令，托管人复核后从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>3、销售服务费</p> <p>销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务等。本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：</p> <p>集合计划销售服务费每日计算，逐日累计至每季度末，按季支付，由管理人于次一季度前 5 个工作日内向托管人发</p>	<p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金托管费</p> <p>基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>3、C 类基金份额的销售服务费</p> <p>本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：</p> <p>C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月月初 5 个工作日</p>
--	--	---

	<p>送集合计划销售服务费划款指令，托管人复核后从集合计划财产中一次性支付给管理人，经管理人代付给各销售机构。</p> <p>若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>三、不列入集合计划费用的项目</p> <p>3、《资产管理合同》生效前的相关费用按《长城季季红1号集合资产管理合同》约定执行；</p> <p>四、实施侧袋机制期间的集合计划费用</p> <p>本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，且不得收取管理费，详见招募说明书的规定。</p>	<p>内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用按《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》约定执行；</p> <p>四、实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。</p>
<p><b>第十六部分 基金的收益与分配</b></p>	<p>三、集合计划收益分配原则</p> <p>1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划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；</p> <p>3、集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p>	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>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；</p> <p>3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基</p>

	<p>4、由于本集合计划各类份额的费用收取方式存在不同，各类别份额对应的可供分配收益将有所不同，管理人可对各类份额分别制定收益分配方案。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；</p> <p>在不影响投资者利益的情况下，管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。</p>	<p>金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>4、由于本基金各类基金份额的费用收取方式存在不同，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；</p> <p>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，但应于变更实施日前在规定媒介公告。</p>
<p><b>第十七部分 基金的会计与审计</b></p>	<p>一、集合计划会计政策</p> <p>1、管理人为本集合计划的会计责任方。</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的基金会计责任方。</p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></p>	<p>一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《资产管理合同》及其他有关规定。</p> <p>五、公开披露的集合计划信息</p> <p>(一) 招募说明书、《资产管理合同》、托管协议、产品</p>	<p>一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(一) 基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、</p>

	<p>资料概要</p> <p>《长城季季红 1 号集合资产管理合同》变更为《资产管理合同》的申请经中国证监会批准后，管理人应将招募说明书提示性公告和《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，将招募说明书、产品资料概要、《资产管理合同》和托管协议登载在规定网站上，并将产品资料概要登载在集合计划销售机构网站或营业网点；托管人应当同时将《资产管理合同》、托管协议登载在网站上。</p> <p>(二) 《资产管理合同》生效公告</p> <p>管理人应当在收到中国证监会批准文件后在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告。</p> <p>(三) 集合计划净值信息</p> <p>在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、集合计划销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在</p>	<p>基金产品资料概要</p> <p>集合计划份额持有人大会审议通过变更注册后，基金管理人应将招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。</p> <p>(二) 基金净值信息</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次</p>
--	--	--

	<p>规定网站披露半年度和年度最后一日的各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>(五) 定期报告，包括年度报告、中期报告和季度报告</p> <p>管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。</p>	<p>日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。</p> <p>(四) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。</p>
--	--	--



	<p>管理人应当在年度报告和中期报告中披露集合计划组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>本集合计划发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；</p> <p>8、管理人的高级管理人员、投资经理和托管人专门托管部门负责人发生变动；</p> <p>9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，管理人、托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；</p> <p>10、涉及集合计划财产、资产管理业务、托管业务的诉讼或仲裁；</p>	<p>基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>(五) 临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；</p> <p>8、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；</p> <p>9、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；</p> <p>10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；</p>
--	---	---

	<p>11、管理人或其高级管理人员、投资经理因资产管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门托管部门负责人因集合计划托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；</p> <p>(七) 澄清公告</p> <p>在《资产管理合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对集合计划份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害集合计划份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>(九) 投资资产支持证券信息披露</p> <p>管理人应在年报及中期报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。</p> <p>管理人应在季度报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划净资产比例大小排序的前 10 名资产</p>	<p>11、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金资产管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；</p> <p>(六) 澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。</p> <p>(八) 投资资产支持证券信息披露</p> <p>基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露基金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。</p> <p>基金管理人应在基金季度报告中披露基金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</p>
--	--	--

	<p>支持证券明细。</p> <p>（十一）投资国债期货的相关公告</p> <p>管理人在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>六、信息披露事务管理</p> <p>托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《资产管理合同》的约定，对管理人编制的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回价格、定期报告、更新的招募说明书、产品资料概要、集合计划清算报告等相</p>	<p>证券明细。</p> <p>（十）投资国债期货的相关公告</p> <p>基金管理人在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标等。</p> <p>（十一）清算报告</p> <p>基金合同终止情形出现时，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公</p>
--	---	--

	<p>关集合计划信息进行复核、审查，并向管理人进行书面或电子确认。</p> <p>管理人、托管人应当在规定报刊中选择披露信息的报刊。管理人、托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的集合计划信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。</p> <p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：</p> <p>1、集合计划投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p>	<p>开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。</p> <p>基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。</p> <p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p> <p>1、基金投资所涉及的证券/期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p>
--	---	---

	2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；	2、不可抗力； 3、出现《基金合同》约定的暂停估值的情形时；
<b>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</b>	<p>一、《资产管理合同》的变更</p> <p>1、变更资产管理合同涉及法律法规规定或本合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的，应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和资产管理合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。</p> <p>三、集合计划财产的清算</p> <p>1、集合计划财产清算小组：自出现《资产管理合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。</p>	<p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。</p> <p>三、基金财产的清算</p> <p>1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。</p>
<b>第二十部分 违约责任</b>	一、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《资产管理合同》约定，给集	一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，

	<p>合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人免责：</p> <p>2、管理人、托管人按照当时有效的法律、法规、规章或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失；</p> <p>3、管理人对按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失。</p>	<p>给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，一方承担连带责任后有权根据另一方过错程度向另一方追偿。对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人免责：</p> <p>2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；</p> <p>3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。</p>
<b>第二十一部分 争议的 处理和适用的法律</b>	《资产管理合同》受中国法律（为本协议之目的，不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。	《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。
<b>第二十二部分 基金合 同的效力</b>	1、《资产管理合同》经管理人、托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签名或盖章并经管理人向中国证监会提交变更《长城季季红 1 号集合资产管理合同》的申请并经中国证监会批准后，自集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《长城季季红 1 号集合资产管理合同》同日起失效。	1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖公章以及双方法定代表人或授权代表签名或盖章并经长城证券中短债债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决通过后，自基金管理人公告的生效之日起生效，原《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。