

长城基金管理有限公司关于长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划 变更注册为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金相关业务安排的公告

依据《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》、《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》等法律法规的规定和《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》的约定，并经中国证监会 2025 年 1 月 20 日证监许可[2025]101 号文准予，长城证券股份有限公司旗下的长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”）以通讯方式召开了集合计划份额持有人大会，于 2025 年 2 月 24 日表决通过了《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》。自 2025 年 3 月 12 日起，集合计划变更为长城三个月滚动持有债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），集合计划的管理人由长城证券股份有限公司变更为长城基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）。

一、集合计划份额持有人大会会议情况

集合计划以通讯方式召开了集合计划份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2025 年 1 月 24 日起至 2025 年 2 月 21 日 17:00 止。会议审议了《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“本次会议议案”），并由参与本次集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人或其代理人对本次会议议案进行表决。根据《长城证券股份有限公司关于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结果暨决议生效的公告》，本次集合计划份额持有人大会于 2025 年 2 月 24 日表决通过了本次会议议案，本次会议决议自该日起生效。

二、本次变更注册的主要内容

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
产品代码	A类:970064、B类:970065、 C类:970066	A类:023586、B类:023587、 C类:023588
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	<p>5、信用债投资策略</p> <p>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。</p> <p>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>(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%。</p>	<p>5、信用债(含资产支持证券,下同)投资策略</p> <p>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。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:</p> <p>(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%;</p> <p>(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%。</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</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。</p>	<p>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>7、可转换债券、可交换债券投资策略 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%。</p>	<p>7、可转换债券、可交换债券投资策略</p>
	<p>（二）资产支持证券投资策略 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。</p>	
<p>投资限制</p>	<p>（9）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； （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； （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：</p>	<p>（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%；</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>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%。</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。可转换债券、可交换债券不受此评级和投资比例限制。</p> <p>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%;</p>	
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%

三、变更注册的相关业务安排

1、自 2025 年 3 月 12 日起，《长城三个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）生效，《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》同时失效。自《基金合同》生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

2、自 2025 年 3 月 13 日起，本基金 A 类、C 类基金份额开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务。本基金对每份 A 类、C 类基金份额设置 3 个月滚动运作期。每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。

自 2025 年 3 月 13 日起，本基金 B 类基金份额开放赎回、转换转出业务。本基金 B 类基金份额不开放申购、转换转入、定期定额投资业务，不设置滚动运作期。

3、份额持有人基金账户的开立

自《基金合同》生效之日起，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，份额持有人需开立长城基金管理有限公司基金账户，以便进行基金份额登记业务。具体可由原销售机构根据其份额持有人已经提供的有效资料代为办理基金账户的开户手续，份额持有人也可以联系原销售机构自行办理基金账户开户手续。未开立长城基金管理有限公司基金账户的，份额持有人后续申购、赎回基金份额的时效性、便利性将受到不利影响。

本基金管理人将根据业务、系统实际情况以及与销售机构的沟通情况确定份额持有人的基金份额登记规则。特殊情况下，份额持有人持有的本产品份额在销售机构对应的交易账户可能有所变化。

四、其他需要提示的事项

1、本基金将根据中国证券投资基金业协会《关于固定收益品种的估值处理标准》等相关规定相应调整估值方法。

2、本基金的会计师事务所变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

3、本公告仅对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的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读刊登于本基金管理人网站（<http://www.ccfund.com.cn>）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund/>）的本基金《基金合同》、招募说明书及基金产品资料概要等信息披露文件和相关业务公告。

4、投资者可以拨打本基金管理人客服热线（400-8868-666）或登录本基金管理人网站获取相关信息。

特此公告。

长城基金管理有限公司

2025年3月12日