

长城证券中短债债券型集合资产管理计划基金产品资料概要更新

编制日期：2024年10月16日

送出日期：2024年10月23日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|--|-------------|----------------------------|
| 基金简称 | 长城证券中短债 | 基金代码 | 970075 |
| 基金简称A | 长城证券中短债A | 基金代码A | 970075 |
| 基金简称C | 长城证券中短债C | 基金代码C | 970076 |
| 基金管理人 | 长城证券股份有限公司 | 基金托管人 | 华夏银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2021年10月26日 | 上市交易所及上市日期 | 暂未上市 |
| 基金类型 | 债券型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 本集合计划A类、C类份额每个开放日开放申购、赎回业务 |
| 基金经理 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 证券从业日期 | |
| 张轩 | 2021年04月20日 | 2009年04月16日 | |
| 徐越 | 2022年01月14日 | 2015年09月16日 | |
| 其他 | 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。 | | |

注：本报告所述“基金”也包括按照《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》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。长城证券中短债债券型集合资产管理计划是长城季季红1号集合资产管理计划变更而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2021]2787号文，准予变更。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

具体请查阅本集合计划的《招募说明书》第十部分“集合计划的投资”了解详细情况。

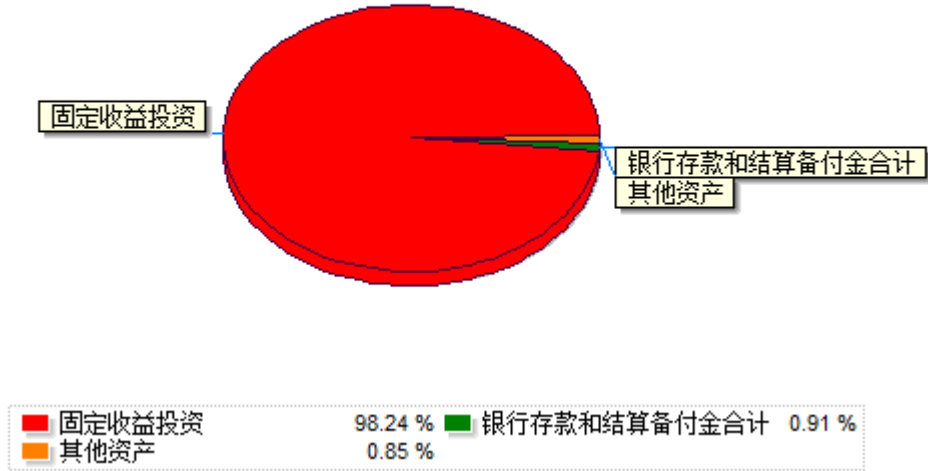
| | |
|------|---|
| 投资目标 | 在科学严格管理风险的前提下，主要投资中短期债券，力求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资范围 | 本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持机构债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、由中国证监会批准在中国金融期货交易所上市交易的以国债为标的的金融期货合约（以下简称 |

| | |
|---------------|---|
| | <p>“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>如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> |
| <p>主要投资策略</p> | <p>1、 固定收益品种投资策略</p> <p>根据对未来债券市场的判断,组合采用战略性配置与战术性交易结合的方法,将核心资产重点持有,并结合市场上出现的机会进行战术配置调整。在具体操作中,组合将根据具体的市场情况和新品种发行的情况,控制并调整建仓和配置的过程。</p> <p>其中信用债投资策略为相同资信等级的公司债在利差期限结构上服从凸性回归均衡的规律。内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动,另外在经济上升或下降的周期中公司债利差将缩小或扩大。管理人可以通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差交易策略。</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>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>2、 国债期货投资策略:</p> <p>本集合计划将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,按照中国金融期货交易所在套期保值管理的有关规定适度参与国债期货投资。</p> <p>3、 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、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>业绩比较基准</p> | <p>中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。</p> |

| | |
|--------|---|
| 风险收益特征 | 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。 |
|--------|---|

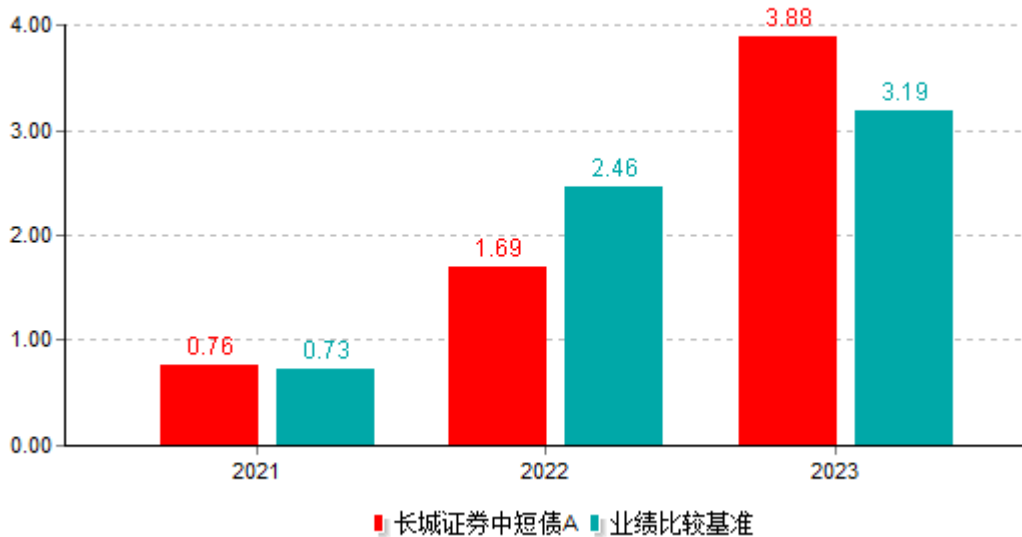
(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年06月30日

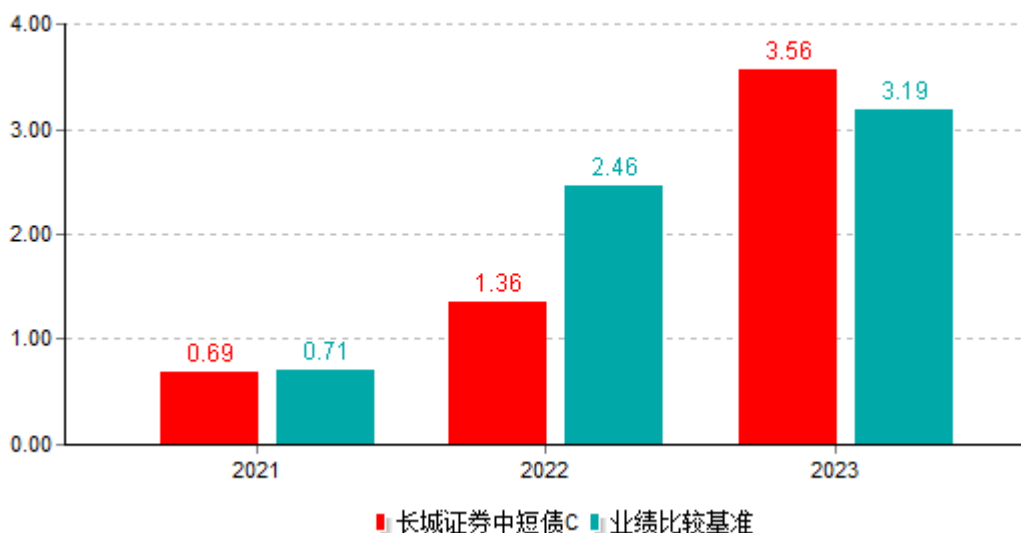


(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日
单位%



基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日
单位%



三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

长城证券中短债A

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|-----------|---------------------------|------------|--------|
| 认购费 | | | 不收取认购费 |
| 申购费 (前收费) | M < 100万 | 0.30% | |
| | 100万 ≤ M < 500万 | 0.20% | |
| | M ≥ 500万 | 1000.00元/笔 | 按笔收取 |
| 赎回费 | N < 7天 | 1.50% | |
| | N ≥ 7天 | 0.00% | |

注：投资人如果有多笔申购，A类集合计划份额的申购费按每笔A类集合计划份额申购申请单独计算。

长城证券中短债C

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|-----------|---------------------------|---------|--------|
| 认购费 | | | 不收取认购费 |
| 申购费 (前收费) | | | 不收取申购费 |

| | | | |
|-----|------|-------|--|
| 赎回费 | N<7天 | 1.50% | |
| | N≥7天 | 0.00% | |

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 | 收取方 |
|--------|---|--------|
| 管理费 | 0.30% | 基金管理人 |
| 托管费 | 0.10% | 基金托管人 |
| 销售服务费A | 0.00% | 销售机构 |
| 销售服务费C | 0.30% | 销售机构 |
| 审计费用 | 5,088.00 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 《资产管理合同》生效后与集合计划相关的律师费和诉讼费、仲裁费等；份额持有人大会费用；证券/期货交易费用；银行汇划费用；开户费用、账户维护费用；按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。 | 相关服务机构 |

注：

1、集合计划运作过程中可能发生的其他费用详见本集合计划的《招募说明书》第十四部分“集合计划的费用与税收”。

2、本集合计划交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除。

3、审计费用、信息披露费为集合计划整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以集合计划定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

长城证券中短债A

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 0.44% |

注：集合计划管理费率、托管费率为集合计划现行费率，其他运作费用以最近一次集合计划年报披露的相关数据为基准计算。

长城证券中短债C

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 0.74% |

注：集合计划管理费率、托管费率、销售服务费率为集合计划现行费率，其他运作费用以最近一次集合计划年报披露的相关数据为基准计算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划在投资运作过程中可能面临各种风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作或技术风险、合规性风险、其它风险及特定风险等。

1、市场风险

本集合计划主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致集合计划收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）利率风险；（4）信用风险；（5）购买力风险。

2、管理风险

在集合计划管理运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响集合计划收益水平。

3、流动性风险

集合计划的流动性风险主要表现在两方面：一是管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于证券的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将证券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当证券的流动性较差时，管理人被迫在不适当的价格大量抛售证券。两者均可能使集合计划净值受到不利影响。主要包括：（1）集合计划申购、赎回安排风险；（2）投资市场、行业及资产的流动性风险；（3）巨额赎回情形下的流动性风险；（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在风险；（5）实施侧袋机制的风险。

4、特定风险

（1）债券市场整体下跌的风险；（2）资产支持证券的投资风险；（3）债券回购风险；（4）国债期货的投资风险。

5、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

6、合规性风险

指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及资产管理合同有关规定的风险。

7、其他风险

（1）因技术因素而产生的风险；（2）因业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；（3）因人为因素而产生的风险；（4）对主要业务人员依赖而可能产生的风险；（5）因战争、自然灾害等不可抗力导致的管理人、销售机构等机构无法正常工作，从

而影响集合计划的申购、赎回按正常时限完成的风险；（6）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，本集合计划份额持有人将面临在2025年4月25日资产管理合同到期的风险。

具体风险请查阅本集合计划《招募说明书》第十八部分“风险揭示”的具体内容。

（二）重要提示

中国证监会对本集合计划募集的注册，并不表明其对本集合计划的价值和收益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。

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划财产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和资产管理合同的当事人。

《资产管理合同》生效后，集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，管理人将在三个工作日内更新；其他信息发生变更的，管理人将至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新集合计划产品资料概要。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定滞后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见管理人网站[www.cgws.com][客服电话：95514、400-6666-888]

- 1、《长城证券中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《长城证券中短债债券型集合资产管理计划托管协议》、《长城证券中短债债券型集合资产管理计划招募说明书》
- 2、定期报告，包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告
- 3、集合计划份额净值
- 4、集合计划销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

六、其他情况说明

无。