

关于“长城-能城2号FOF集合资产管理计划” 穿透后的投资比例将符合资管细则要求的说明

尊敬的广大投资者：

我公司设立的长城-能城2号FOF集合资产管理计划（以下简称“本计划”）已于2020年11月10日成立。

在本计划存续期内，我司将会对本计划所投资的金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品及私募基金（以下简称“子基金”）进行穿透式管理，以保证本计划穿透后合并投资同一资产的比例以及同一资产的金额符合《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》等法律法规以及《长城-能城2号FOF集合资产管理计划资产管理合同》的要求。

其中，本计划成立之日起的6个月内为建仓期，建仓期结束后，本计划穿透式管理如下：

- 1、本计划及子基金穿透合并计算投资于固定收益类资产的比例不高于本计划总资产的80%；
- 2、本计划及子基金穿透合并计算投资于权益类资产的比例不高于本计划总资产的80%；
- 3、本计划及子基金穿透合并计算投资于金融衍生品的持仓合约价值的比例不超过本计划总资产的80%。

长城证券股份有限公司
2020年11月26日