

专项计划名称：鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持专项计划

证券代码：168490

证券简称：PR山海优

证券代码：168491

证券简称：山海01次

## 关于鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持专项计划票面利率调整及专项开放程序启动的提示性公告

本公司保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担相应的法律责任。

### 特别提示：

#### 1、票面利率调整

鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持专项计划发行时票面利率为 3.5%，现将票面利率上调为 4%。

#### 2、退出开放登记期

退出开放登记期为 S-44 日（即 2023 年 2 月 15 日）9:00 至 S-30 日（即 2023 年 3 月 7 日）17:00 之间的期间。

### 一、专项计划与资产支持证券的基本信息

鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持专项计划（以下简称“专项计划”）自 2020 年 6 月 4 日由长城证券（以下简称“管理人”）设立并开始运作。专



项计划设置优先级和次级两种资产支持证券，基本信息如下：

证券代码	证券简称	起息日	到期日	收益分配方式	信用评级	年化收益率	发行金额 (亿元)	未偿本金余 额(亿元)
168490	PR 山海优	2020/6/4	2032/4/19	按季还本付息	AAA	3.5%	30	29.085
168491	山海 01 次	2020/6/4	2032/4/19	按季度分配专项计划 账户内剩余收益(如 有)	/	/	0.3	0.30

## 二、资产支持证券票面利率调整的基本情况

### (一) 优先级资产支持证券的票面利率调整安排

根据《鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持专项计划说明书》、《鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持专项计划之标准条款》的约定：

计划管理人应当在退出开放启动日公告启动专项计划开放程序，并同时公告优先级资产支持证券的票面利率的调整结果（如有）。

退出开放启动日为开放参与日前的第 45 个交易日（即 S-45 日，即 2023 年 2 月 14 日）；在退出开放程序中，开放参与日（S 日）指专项计划设立日所在的公历年度起（不含当年）的第 3、6 及 9 个公历年度的【4】月【19】日，如遇非交易日则往后顺延至第 1 个交易日。

计划管理人应当在开放参与日前的第 50 个交易日（即 S-50 日，即 2023 年 2 月 7 日）至第 46 个交易日（即 S-46 日，即 2023 年 2 月 13 日）之间的期间就自最近一个开放参与日起优先级资产支持证券适用的票面利率是否调整以及调整幅度分别征询流

动性支持义务人及优先级资产支持证券持有人的意见。最终调整结果以计划管理人在退出开放启动日公告的优先级资产支持证券的票面利率调整结果为准。

(二) 本次票面利率调整有关事项如下:

证券代码	证券简称	预计到期日	发行金额(亿元)	发行利率	剩余本金余额(亿元)	调整后票面利率	票面利率调整生效日
168490	PR 山海优	2032/4/19	30	3.5%	29.085	4%	2023/4/19

### 三、专项计划开放程序安排

#### (一) 专项计划的退出开放

##### 1、退出开放登记期

退出开放登记期为 S-44 日(即 2023 年 2 月 15 日) 9:00 至 S-30 日(即 2023 年 3 月 7 日) 17:00 之间的期间。

##### 2、物业评估

计划管理人应当在专项计划设立起每年(不含专项计划设立日所在当年)的第 6 个月前代表专项计划聘请具有证券、期货从业资质及专业资产评估资质的专业资产评估机构或其他符合上交所要求的专业资产评估机构对目标物业进行定期的物业评估,并由专业资产评估机构向计划管理人出具目标物业的《物业评估报告》。如该年度为退出开放程序所在年度的,则计划管理人应当要求专业资产评估机构在退出开放程序启动前向计划管理人出具《物业评估报告》。

##### 3、发布公告

计划管理人应当在退出开放启动日(S-45 日,即 2023 年 2

月 14 日) 在管理人网站及上交所网站发布关于接受优先级资产支持证券持有人退出登记申请的通知, 并同时公告优先级资产支持证券的票面利率的调整结果(如有)。

#### 4、退出登记申请

有退出权的资产支持证券持有人有权在退出开放登记期内任何一个交易日的 9:00-17:00 的时间段内, 根据计划管理人所发布的接受退出登记申请的通知中关于退出登记申请的格式及要求, 向计划管理人发出退出登记申请。

#### 5、退出登记申请的撤回

有退出权的资产支持证券持有人有权在退出开放登记期内任何一个交易日的 9:00-17:00 的时间段内, 根据计划管理人所发布的接受退出登记申请的通知中关于撤回退出登记申请的格式及要求, 向计划管理人撤回退出登记申请。但自 S-32 日(即 2023 年 3 月 3 日) 17:00 起, 优先级资产支持证券持有人不得撤回其退出登记申请。

#### 6、退出份额

有退出权的资产支持证券持有人可以申请全部或部分退出专项计划。选择申请部分退出专项计划的有退出权的资产支持证券持有人在部分退出专项计划后持有的资产支持证券本金余额不得低于 100 万元(不含 100 万元)。如计划管理人发现有退出权的资产支持证券持有人申请部分退出专项计划将致使其所持有的资产支持证券本金余额低于 100 万元(不含 100 万元)的, 管理人有权自主选择: a. 减少该有退出权的资产支持证券持有人申请的退出份额, 以保证在其持有的部分优先级资产支持证券退出

专项计划后该有退出权的资产支持证券持有人持有的资产支持证券本金余额不低于 100 万元；或 b. 要求该优先级资产支持证券持有人全部退出专项计划。

#### 7、申请退出份额核算及确认登记

计划管理人将在 S-29 日（即 2023 年 3 月 8 日）9:00-17:00 期间，对退出登记申请所涉及的优先级资产支持证券份额进行核算及确认登记。

#### 8、视为已退出

自 S-29 日（即 2023 年 3 月 8 日）9:00 起至 S-1 日（即 2023 年 4 月 18 日）24:00 止的期间，任何拟退出资产支持证券若发生交易，则该部分已交易资产支持证券视为已退出专项计划。

#### 9、行使优先收购权、标的债权提前到期通知及回复

计划管理人应于 S-29 日（即 2023 年 3 月 8 日）至 S-28 日（即 2023 年 3 月 9 日）期间就已确认登记的拟退出专项计划的优先级资产支持证券的份额及金额通知优先收购权人并同时抄送流动性支持义务人，并要求优先收购权人 S-12 日（即 2023 年 3 月 31 日）24:00 前书面回复计划管理人是否选择启动 I “行使优先收购权”，即由优先收购权人一次性收购由除鲁能集团及三亚湾新城公司以外的其他优先级资产支持证券持有人持有的全部优先级资产支持证券并提前终止专项计划；或 II “标的债权一次性提前到期”，即由借款人一次性清偿标的债权项下的全部未偿本息，标的债权提前到期且专项计划提前终止。

#### 10、流动性支持程序

(1) 如优先收购权人未在 S-12 日（即 2023 年 3 月 31 日）

24:00 前书面回复计划管理人确定选择启动“行使优先收购权”或“标的债权一次性提前到期”或未在 S-12 日 24:00 前进行任何书面回复或通知，则视为优先收购权人不启动“行使优先收购权”及“标的债权一次性提前到期”，流动性支持义务人应当就拟退出资产支持证券的退出提供流动性支持。

(2) 截至 S-5 日（即 2023 年 4 月 12 日）00:00，如未退出专项计划的拟退出资产支持证券份额的余额大于 0，则计划管理人应于 S-5 日（即 2023 年 4 月 12 日）向流动性支持义务人发出《流动性支持通知书》，通知流动性支持义务人就已确认登记且截至 S-5 日（即 2023 年 4 月 12 日）00:00 仍未退出专项计划的优先级资产支持证券的退出提供流动性支持金；流动性支持义务人应当自行【或指定第三方】在 S-2 日（即 2023 年 4 月 17 日）向管理人指定的证券资金账户支付流动性支持金，流动性支持金额应等额于计划管理人于 S-5 日（即 2023 年 4 月 12 日）通知流动性支持义务人为提供流动性支持需准备的流动性支持金。流动性支持义务人承诺，流动性支持义务人【或其指定第三方】将在 S 日自证券资金账户向中证登上海分公司指定的账户划付等额于流动性支持金的款项，并最终由中证登上海分公司向申请退出专项计划的优先级资产支持证券持有人分别支付相应的购买价款，并办理资产支持证券过户手续。

(3) 若流动性支持义务人或其指定的第三方未按时足额支付流动性支持金、或未按时足额支付拟退出资产支持证券购买价款，同时构成专项计划、《债权转让与还款安排协议》及《流动性支持协议》项下之违约事件，计划管理人有权要求信托受托人宣告

标的债权提前到期并行使包括目标物业抵押权在内的《债权转让与还款安排协议》相关担保权益。在此情形下，专项计划提前到期。流动性支持义务人【或其指定第三方】于S日（即2023年4月19日）向拟退出资产支持证券的持有人支付的购买价款为截至S日（即2023年4月19日）之次一自然日00:00的未偿投资本金。

#### （4）专项计划收益兑付

为避免疑义，拟退出资产支持证券持有人，若截至当期权益登记日仍持有拟退出资产支持证券的，则其仍就其持有的拟退出资产支持证券份额参与该权益登记日所对应的兑付日的当期分配。

#### （5）资产支持证券的过户

在开放参与日（S日，即2023年4月19日），计划管理人应协助参与拟退出资产支持证券买卖双方办理资产支持证券过户手续。在完成过户手续后，原持有人不再持有已过户资产支持证券，不再就已过户资产支持证券享有专项计划合同项下的权利及利益。

如因任何原因导致流动性支持义务人或其指定第三方已支付的流动性支持金大于S日（即2023年4月19日）当天流动性支持义务人或其指定第三方为购入拟退出的优先级资产支持证券而需支付的购买价款的，流动性支持义务人或其指定的第三方仅需要自证券资金账户通过向中证登上海分公司指定的账户划付相应资金并最终实现向拟退出资产支持证券的持有人支付相应的购买价款。

## 11、优先收购权行使程序

(1)如优先收购权人在 S-12 日(即 2023 年 3 月 31 日)24:00 前回复计划管理人选择行使优先收购权,则专项计划进入优先收购权行使程序,流动性支持义务人不再就拟退出资产支持证券提供流动性支持。

(2)优先收购权人应当于优先收购权购买行权日前的第 2 个交易日(即 S-2 日,即 2023 年 4 月 17 日)当天 16:00 前向管理人指定的证券资金账户一次性支付非由鲁能集团或三亚湾新城公司持有的优先级资产支持证券收购价款,其中,优先收购权购买行权日即为 S 日(原“开放参与日”)。非由鲁能集团或三亚湾新城公司持有的优先级资产支持证券的收购价款为【除鲁能集团或三亚湾新城公司以外的其他优先级资产支持证券持有人所持有的全部优先级资产支持证券截至 S 日(即 2023 年 4 月 19 日)之次一自然日 00:00 的未偿投资本金】。

(3)优先收购权人应当于在 S 日(即 2023 年 4 月 19 日)自证券资金账户向中证登上海分公司指定的账户划付等额于收购价款的款项,并最终由中证登上海分公司向除其本人及鲁能集团外的其他所有优先级资产支持证券持有人分别支付相应的购买价款,并办理资产支持证券过户手续。

(4)若优先收购权人未按时足额支付收购价款、或未按时足额支付除鲁能集团或三亚湾新城公司以外的其他优先级资产支持证券持有人持有的任一优先级资产支持证券购买价款的,同时构成专项计划、《债权转让与还款安排协议》及《优先收购权协议》项下之违约事件,计划管理人有权要求信托受托人宣告标的

债权提前到期并行使包括目标物业抵押权在内的《债权转让与还款安排协议》相关担保权益。在此情形下，专项计划提前到期。

#### (5) 专项计划收益兑付

为避免疑义，截至 S 日（即 2023 年 4 月 19 日）之前最近一个权益登记日仍持有优先级资产支持证券的，则其仍就其持有的将在 S 日（即 2023 年 4 月 19 日）被优先收购权人收购的优先级资产支持证券份额参与该权益登记日所对应的兑付日（即 S 日，即 2023 年 4 月 19 日）的当期分配。

#### (6) 资产支持证券的过户

在开放参与日（S 日，即 2023 年 4 月 19 日），计划管理人应协助除优先收购权人及鲁能集团之外的其他优先级资产支持证券持有人办理资产支持证券过户手续。在完成过户手续后，原持有人不再持有已过户资产支持证券，不再就已过户资产支持证券享有专项计划合同项下的权利及利益。

(7) 计划管理人应当在开放参与日的前一交易日（S-1 日，即 2023 年 4 月 18 日）发布《专项计划提前到期公告》，专项计划提前到期日为 S 日（即 2023 年 4 月 19 日）。

八  
七

#### 四、管理人联系方式

通讯地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔  
10-19 楼

法定代表人：张巍

联系人：彭勤

联系电话：19102850171

邮箱：pengqin@cgws.com

特此公告。



长城证券股份有限公司

2023年2月3日

附件 1:

## 关于鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格 精选酒店资产支持专项计划接受退出专项计划登记申请的通 知

尊敬的优先级资产支持证券持有人:

鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持专项计划(以下简称“专项计划”)开放程序拟启动,专项计划开放程序安排详见《关于鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持专项计划票面利率调整及专项开放程序启动的提示性公告》,管理人长城证券股份有限公司自 2023 年 2 月 15 日起接受专项计划优先级资产支持证券持有人退出登记申请。请拟退出的优先级资产支持证券持有人参照下文所示要素,填写附件 2《鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持证券退出登记申请》,以电子邮件或传真方式向管理人提出书面申请。

证券代码: 168490、168491

证券简称: PR 山海优、山海 01 次

剩余规模: 截至开放参与日, PR 山海优份数 3,000 万份,每份剩余面值 96.95 元,剩余规模 29.085 亿元。

开放退出登记期间: 2023 年 2 月 15 日至 2023 年 3 月 7 日(仅限交易日 09:00-17:00),但自 S-32(即 2023 年 3 月 3 日)的 17:00 时起,优先级资产支持证券持有人不得撤回其退出登记申请。

撤回退出申请: 开放退出登记期间,优先级资产支持证券持有人有权以电子邮件或传真方式向管理人发出通知,撤回其退出登记申请;

但自开放退出登记期终止之日前第 2 个工作日（S-32，即 2023 年 3 月 3 日）的 17:00 时起，优先级资产支持证券持有人不得撤回其退出申请。

开放参与日：2023 年 4 月 19 日，亦为专项计划第 12 个兑付日。

放弃权利：若优先级资产支持证券持有人未按本通知提交申请，则视为放弃相应权利。

专项计划管理人联系方式：

联系人：彭勤

联系地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 15 层

联系电话：19102850171

电子邮件：pengqin@cgws.com

特此通知。

长城证券股份有限公司

2023 年 月 日

附件 2:

鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选  
酒店资产支持证券退出登记申请

长城证券股份有限公司:

\_\_\_\_\_ (以下简称“申请人”)为鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持证券持有人,根据《计划说明书》《标准条款》的约定,拟申请退出。

退出登记申请基本信息如下:

公司名称:

产品名称(如有):

统一社会信用代码/注册号/批文号:

证券账户号码:

托管席位号:

申请退出优先级资产支持证券份额: \_\_\_\_\_份

申请人(公章/业务专用章):

年 月 日

附件 3:

鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选  
酒店资产支持证券撤回退出登记申请

长城证券股份有限公司:

\_\_\_\_\_ (以下简称“申请人”)为鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持证券持有人,根据《计划说明书》《标准条款》的约定,拟申请撤回退出登记申请。

撤回退出登记申请基本信息如下:

公司名称:

产品名称(如有):

统一社会信用代码/注册号/批文号:

证券账户号码:

托管席位号:

撤回申请退出优先级资产支持证券份额: \_\_\_\_\_份

申请人(公章/业务专用章):

年 月 日