

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的公告

本公司全体董事或具有同等职责的人员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。

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日由长城证券股份有限公司设立并开始运作，2025年4月18日专项计划管理人因证券公司设立资产管理子公司从事证券资产管理业务发生变更，由长城证券股份有限公司变更为长城证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）。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）	剩余本金余额（亿元）
168490	PR 山海优	2020/6/4	2032/4/19	按季还本付息	AAA	4.00%	30	26.964
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) 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》和《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专项计划合同标准条款》的约定，票面利率调整条款具体如下：

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）至第 46 个交易日（即 S-46 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。

优先级资产支持证券自专项计划设立日起（含当日）至首个票面利率调整日（不含当日）的预期年化收益率以《认购协议》所载为准。自首个票面利率调整日起（含当日），上述优先级资产支持证券的预期年化收益率根据计划管理人发布的优先级资产支持证券的票面利率调整公告确定。为避免疑义，如计划管理人发布的票面利率调整公告维持优先级资产支持证券的票面利率，则优先级资产支持证券继续适用票面利率调整公告日前的票面利率。

(二) 本次票面利率调整有关事项如下：

根据流动性支持义务人的《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的通知》，本资产支持专项计划的优先级资产支持证券票面利率调整具体情况如下表所示：



证券代码	证券简称	预计到期日	发行金额(亿元)	收益分配方式	票面利率	剩余本金余额(亿元)	调整后票面利率
168490	PR 山海优	2032/4/19	30	按季还本付息	4.00%	26.964	3.1%

调整生效日为 2026 年 4 月 20 日(含该日),本次调整于 2026 年 4 月 20 日(含该日)至专项计划的最后一个兑付日界至或计划管理人再次行使票面利率选择权的结果期间生效。

本次票面利率下调符合《计划说明书》中约定,下调后的票面利率合理、公允。

特此公告。

长城证券资产管理有限公司

2026 年 2 月 5 日

