

# 长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金 招募说明书

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一一年十二月

## 重要提示

本基金经2011年9月15日中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1474号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作风险、合规风险、指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险，以及份额配对转换与基金份额折算等业务办理过程中的特有风险等等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金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基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

## 目 录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	10
四、基金托管人.....	20
五、相关服务机构.....	24
六、基金份额的分级.....	26
七、基金的募集.....	29
八、基金备案与《基金合同》的生效.....	34
九、久兆 300 份额的申购与赎回.....	35
十、久兆稳健份额与久兆积极份额的上市交易.....	42
十一、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记等其他相关业务.....	44
十二、基金的份额配对转换.....	46
十三、基金的投资管理.....	48
十四、基金的财产.....	53
十五、基金资产的估值.....	54
十六、基金的收益分配.....	60
十七、基金的费用与税收.....	61
十八、基金份额折算.....	63
十九、久兆稳健份额与久兆积极份额的终止运作.....	69
二十、基金的会计与审计.....	70
二十一、基金的信息披露.....	70
二十二、风险揭示.....	73
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	76
二十四、基金合同的内容摘要.....	78
二十五、基金托管协议的内容摘要.....	92
二十七、招募说明书的存放及查阅方式.....	104
二十八、备查文件.....	105

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）等有关法律法规及《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人员提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金
2. 基金管理人：指长城基金管理有限公司
3. 基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6. 招募说明书：指《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7. 基金份额发售公告：指《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金份额发售公告》
8. 上市交易公告书：指《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之久兆稳健份额与久兆积极份额上市交易公告书》
9. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
10. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
11. 《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12. 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13. 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
14. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会
15. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
16. 上市交易所：指深圳证券交易所
17. 中小板 300（价格）指数：指在深圳证券交易所中小企业板市场中选取 300 只 A

股作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映中小企业板整体走势。中小板 300 指数由深圳证券信息有限公司编制并发布

18. 基金份额分级：指本基金的基金份额包括长城久兆中小板 300 指数证券投资基金之基础份额、长城久兆中小板 300 指数证券投资基金之稳健份额和长城久兆中小板 300 指数证券投资基金之积极份额。其中，长城久兆中小板 300 指数证券投资基金之稳健份额和长城久兆中小板 300 指数证券投资基金之积极份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变

19. 久兆 300 份额：指长城久兆中小板 300 指数证券投资基金之基础份额

20. 久兆稳健份额：指本基金份额按照基金合同约定规则所分离的稳健收益类基金份额，即长城久兆中小板 300 指数证券投资基金之稳健份额

21. 久兆积极份额：指本基金份额按照基金合同约定规则所分离的积极收益类基金份额，即长城久兆中小板 300 指数证券投资基金之积极份额

22. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

23. 个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

24. 机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

25. 合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

26. 投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

27. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

28. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

29. 销售机构：指直销机构和代销机构

30. 直销机构：指长城基金管理有限公司

31. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

32. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

33. 场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理本基金基金份额的认购、久兆 300 份额的申购和赎回的场所

34. 场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、久兆稳健份额与久兆积极份额上市交易、久兆 300 份额的申购和赎回的场所

35. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

36. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为长城基金管理有限公司或接受长城基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

37. 注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

38. 证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

39. 场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额

40. 场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额

41. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

42. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

43. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

44. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

45. 基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

46. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

47. 运作周年：指自基金合同生效日或前一定期份额折算日次日起至满一年的运作期间

48. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

49. T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

50. T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
51. 开放日：指为投资人办理久兆 300 份额申购、赎回或其他业务的工作日
52. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
53. 《业务规则》：指长城基金管理有限公司开放式基金业务规则，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
54. 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
55. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
56. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
57. 份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金场内的久兆 300 份额与久兆稳健份额、久兆积极份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面
58. 分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每十份久兆 300 份额的场内份额申请转换成四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额的行为
59. 合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额进行配对申请转换成十份久兆 300 份额的场内份额的行为
60. 上市交易：指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖久兆稳健份额、久兆积极份额的行为
61. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为
62. 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作。转托管包括系统内转托管和跨系统转登记
63. 系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
64. 跨系统转登记：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为
65. 定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式



66. 巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%

67. 元：指人民币元

68. 基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额

69. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

70. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

71. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

72. 基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

73. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

74. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人情况

1. 名称：长城基金管理有限公司
2. 住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
3. 办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
4. 法定代表人：杨光裕
5. 组织形式：有限责任公司
6. 设立日期：2001 年 12 月 27 日
7. 电话：0755-23982338                      传真：0755-23982328
8. 联系人：袁柳生
9. 管理基金情况：目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金和长城积极增利债券型证券投资基金十三只基金
10. 客户服务电话：400-8868-666
11. 注册资本：壹亿伍仟万元
12. 股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

#### (二) 基金管理人主要人员情况

##### 1. 董事、监事及高管人员介绍

### (1) 董事

杨光裕先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任，长城证券有限责任公司副总裁，现任长城基金管理有限公司董事长。

何伟先生，中共党员，硕士研究生。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司，1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理，华富基金管理有限公司（筹）拟任总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。现任长城证券有限责任公司总裁。

范小新先生，中共党员，经济学博士，高级经济师。1986年7月参加工作，历任重庆市对外经济贸易委员会副处长，西南技术进出口公司总经理助理，重庆对外经贸委美国公司筹备组组长，中国机电产品进出口商会法律部副主任，华能资本服务有限公司总经理工作部副经理。现任长城证券有限责任公司董事会秘书兼纪委书记、党委委员。

梁宇峰先生，中共党员，复旦大学经济学博士。历任东方证券股份有限公司研究发展总部经理助理、办公室主任助理、研究所副所长，2006年4月至今任东方证券股份有限公司研究所所长。

姬宏俊先生，中共党员，研究生学历，工商管理硕士。历任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长，发展计划委员会财政金融处副处长，国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。现任中原信托有限公司副总裁。

陆妍女士，1991年毕业于天津理工学院管理信息系统专业，获工学学士学位，1997年毕业于天津大学管理学院，获工学硕士学位。曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券投资部项目经理、北方国际信托股份有限公司证券管理总部总经理，现任北方国际信托股份有限公司副总经理。

万建华先生，中共党员，工商管理博士，高级经济师。历任中国人民银行货币政策司处长、招商银行总行副行长、党委副书记、常务副行长、中国银联筹备组组长、党委书记、副董事长、总裁，上海国际集团党委副书记、副董事长、总裁。现任国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长。

谢志华先生，中共党员，经济学博士。历任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商业学校教师、北京商学院（现北京工商大学）副院长、北京工商大学校长助理。2003年至今任北京工商大学副校长。

刘杉先生，经济学博士。曾任中华工商时报社海外部编辑、副主任、中华工商时报财

经新闻部主任，中国人民银行深圳分行金融日报社总编辑，中华工商时报社总编辑助理，现任中华工商时报社副总编辑，兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

谭岳衡先生，中共党员，经济学博士。曾任职于国家发展改革委员会，历任南方证券国际部总经理、南方证券咨询公司董事长、南方证券香港公司副董事长，香港江南财务有限公司董事副总经理、招银国际董事副总经理、长城证券公司董事，招商银行董事、招商证券监事长。现任交银国际控股有限公司首席执行官兼副董事长。

## (2) 监事

吴礼信先生，中共党员，会计师，中国注册会计师（非执业）。历任安徽省地矿局三二六地质队会计主管，深圳中达信会计师事务所审计一部部长，大鹏证券有限责任公司计财综合部经理，大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理，第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券有限责任公司，任财务部总经理，现任长城证券有限责任公司财务总监，并担任长城基金管理有限公司监事会主席。

王燕滨先生，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任内蒙银行学校教师、校团委书记、学生科科长、教研室主任，内蒙古证券公司发行部经理、上海业务部总经理、总经理助理、副总经理，海通证券天津、北京营业部总经理，北方信托业务二部总经理、公司总经理助理兼信托业务二部总经理。现任北方信托总经理助理兼资产管理部总经理。

张令先生，中共党员，研究生学历。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。

孟凡君先生，中共党员，经济学学士，经济师。历任工商银行河南华信资金市场融资二部经理、总经理助理、中原信托投资有限公司开封证券营业部副经理、资产管理部经理，现任中原信托有限公司投资管理二部经理。

桑煜先生，中共党员，经济学学士。曾任职于中国建设银行山东日照市分行、中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司，历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理、市场开发部总经理、综合管理部总经理，现任公司总经理助理兼运行保障部总经理。

张静女士，中共党员，2005年毕业于南开大学，法学硕士。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员，2007年5月至今，任长城基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。

### (3) 高级管理人员

杨光裕先生，长城基金管理有限公司董事长，简历同上。

熊科金先生，经济学硕士。历任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人，中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人，华夏证券有限公司江西管理总部总经理，中国银河证券有限责任公司基金部负责人、银河基金管理有限公司筹备组负责人，银河基金管理有限公司副总经理、总经理。2011年7月进入长城基金管理有限公司，现任公司总经理。

余骏先生，硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经管学院，历任中国人民银行湖北省分行科室负责人，君安证券有限公司研究部宏观室负责人，长城证券有限责任公司营业部总经理，长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理，长城基金管理有限公司副总经理兼运行保障部总经理和综合管理部总经理，长城基金管理有限公司副总经理兼市场开发部总经理，现任公司副总经理。

彭洪波先生，经济学硕士，工学学士，MBA。曾就职于长城证券有限责任公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月加盟长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副经理、部门经理，公司督察长，现任公司总经理助理兼监察稽核部总经理，并代为履行公司督察长职责。

### 2. 本基金基金经理简历

陈硕先生，南开大学生物化学学士、美国乔治敦大学生物化学及分子生物学硕士、美国马里兰大学应用计算机硕士、宾西法尼亚大学沃顿商学院工商管理硕士。具有7年证券从业经历。2004年1月至2008年2月就职于美国巴克莱资本公司，从事全球公司债券及衍生品交易管理，历任经理、副董事。2008年进入长城基金管理有限公司，2008年4月至2009年5月任国际业务部高级研究员，从事宏观策略、行业及上市公司研究工作。自2009年5月至今任“久嘉证券投资基金”基金经理。

### 3. 本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

余骏先生，投资决策委员会委员，代理投资决策委员会主席，公司副总经理。

杨建华先生，投资决策委员会执行委员，投资总监兼基金管理部总经理。

杨毅平先生，投资决策委员会委员，公司首席策略分析师。

秦玲萍女士，投资决策委员会委员，公司研究部总经理。

### 4. 上述人员之间不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

## 1. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- (2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (3) 发售基金份额；
- (4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- (6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (10) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (13) 依法召集基金份额持有人大会；
- (14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式

管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制中期和年度基金报告；

(13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(27) 法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

#### (四) 基金管理人承诺

##### 1. 基金管理人承诺

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

##### 2. 基金管理人的禁止性行为

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

#### (五) 基金经理承诺

1. 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
2. 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
3. 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
4. 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (六) 基金管理人的内部控制制度

健全、完善的内部风险控制制度是规范公司行为，有效防范经营风险，实现公司持续、稳健发展的主要保证，也是公司经营管理水平的重要标志。为此，公司建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度。

##### 1. 风险控制的目标

公司风险控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理实体。具体目标是：

- (1) 确保国家法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行；



(2) 建立符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制；

(3) 不断提高基金管理的效率和效益，在有效控制风险的前提下，努力实现基金份额持有人利益最大化；

(4) 努力将各种风险控制在规定的范围内，保障公司发展战略和经营目标的全面实施，维护公司股东的合法权益；

(5) 建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度。

## 2. 建立风险控制制度的原则

公司按照合法、合规、稳健的要求，制定明确的经营方针，建立合理的经营机制。在建立风险控制制度时应严格遵循以下原则：

(1) 全面性原则：风险控制制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

(2) 审慎性原则：内部风险控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(3) 独立性原则：公司风险控制的检查、评价部门应当独立于风险控制的建立和执行部门；风险控制委员会、合规审查委员会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行评价和检查；

(4) 有效性原则：风险控制制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行风险控制制度不能存在任何例外，公司任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(5) 适时性原则：内部风险控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

(6) 防火墙原则：公司基金投资、研究策划、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序。

## 3. 风险控制的主要内容

(1) 确立加强内部风险控制的指导思想，确定风险控制的目标和原则；

(2) 建立层次分明、权责明确的风险控制体系；

(3) 建立公司风险控制程序；

(4) 对公司内部风险进行全面、系统的评估，制定风险控制计划；

- (5) 确定公司风险控制的路径和措施；
- (6) 保障风险控制制度的持续性和有效性，制定可行的风险控制制度的评价和检查机制。

#### 4. 风险控制体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构，并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级风险防范体系：

##### (1) 一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风险控制与审计委员会，负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。对公司内部控制制度的有效性进行评价，对公司经营管理和基金业务运作的合法合规性进行监督检查，协助董事会建立并有效维持公司内部控制系统，对公司经营中的风险进行研究、分析和评估，并提出风险防范措施和建议，保证公司的规范健康发展。风险控制与审计委员会的基本职能为：

- ①协助董事会建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制组织体系和制度体系。
- ②审查、评价公司基金投资管理制度、市场营销管理制度、风险管理制度等各项内部控制制度的合法合规性、合理性和有效性。
- ③检查和评价公司管理和资产经营、基金管理和资产经营中对国家有关法律法规、中国证监会部门规章以及基金合同的遵守和执行情况，并出具评估意见或改正方案；
- ④定期或不定期听取公司主要经营管理人员关于风险管理工作的汇报；
- ⑤检查和评价公司各项内部控制制度的执行情况并提出改进意见；
- ⑥评估公司管理和基金管理中存在或潜在的风险，检查和评价公司各项业务风险控制工作的有效性，并提出改进意见；
- ⑦检查公司会计政策、财务状况和财务报告程序，与外部审计机构进行交流；
- ⑧对公司内部控制和风险管理工作进行考核；
- ⑨董事会安排的其他事项。

公司设督察长。督察长作为风险控制与审计委员会的执行机构，对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制与审计委员会的授权进行工作。

##### (2) 二级风险防范

二级风险防范是指在公司投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。

投资决策委员会在总经理的领导下，研究并制定公司基金资产的投资战略和投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。其在风险控制中主要职责为：

- ①研究并确立公司的基金投资理念和投资方向；
- ②决定基金资产在现金、债券和股票中的分配比例；
- ③审核基金经理提出的投资组合方案，对其运作过程中的风险进行评估和控制；
- ④批准基金经理拟订的投资原则，对基金经理做出投资授权；
- ⑤对超出投资决策委员会执行委员及基金经理权限的投资项目作出决定。

监察稽核部在总经理的领导下，独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。其在风险控制中主要职责是：

- ①根据各项风险的产生环节，和相关的业务部门一起，共同制定对风险的事前防范和事后审查方案；
- ②就各部门内部风险控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告及建议职能；
- ③调查公司内部的违规案件，协助监管机构处理相关事宜；
- ④对基金运作和公司内部管理进行日常监督与稽核，并向总经理汇报。

### （3）三级风险防范

三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，达到：

- ①一线岗位双人双职双责，互相监督；直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位，实行双人负责；属于单人、单岗处理的业务，强化后续的监督机制；
- ②相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。关键部门和相关岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道，各部门和岗位分别在自己的授权范围内承担各自的职责，将风险控制的最小范围内。

## 5. 基金管理人关于内部合规控制声明书

- （1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- （2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部风险控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：张建国（代行）

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2011 年 3 月 31 日，中国建设银行资产总额 113,125.16 亿元，较上年末增加 5,021.99 亿元，增长 4.65%。2011 年一季度，中国建设银行实现净利润 472.33 亿元，较上年同期增长 34.23%；年化平均资产回报率 1.71%，年化加权平均净资产收益率 26.19%；利息净收入 716.30 亿元，较上年同期增长 25.27%；净利差为 2.58%，净利息收益率为 2.69%，分别较上年同期提高 0.28 和 0.30 个百分点；手续费及佣金净收入 231.54 亿元，较上年同期增长 37.29%。其中，结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长，收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有 1.3 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科设有代表处，设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行 9 家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM) 39,874 台，拥有员工 313,867 人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010 年共获得 100 多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第二位，在“全球银行品牌 500 强”列第 13 位，并被评为 2010 年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的“Interbrand2010 年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为 2010 年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切

实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 6 月 30 日，中国建设银行已托管 195 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010 年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为 2009 年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

##### 1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

##### 2. 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

##### 3. 内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合

同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2. 监督流程

(1) 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出电话提醒及书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

（1）长城基金管理有限公司深圳直销中心

地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

电话：0755-23982244

传真：0755-23982259

联系人：黄念英

（2）长城基金管理有限公司北京直销中心

地址：北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心大厦 916、917 室

电话：010-88091157

传真：010-88091075

联系人：王玲

（3）长城基金管理有限公司上海直销中心

地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1804 室

电话：021-51150756

传真：021-51150756

联系人：邱文勋

（4）网上直销

个人投资者可以通过本公司网上直销交易平台办理本基金的开户和认购手续，具体交易细则请参阅本公司网站相关信息。

网址：<https://www.ccfund.com.cn/etrading/>

#### 2. 场外代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：张建国（代行）

电话：010-66275654

传真：010-66275654

联系人：张静

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（2）其他场外代销机构情况详见本基金基金份额发售公告。



基金管理人可根据业务发展需要，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

### 3. 场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

#### （二）基金注册登记机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：杨光裕

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：张真珍

客户服务电话：400-8868-666

#### （三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO A 座 31 层

负责人：王玲

经办律师：靳庆军、宋萍萍

电话：0755-22163333

传真：0755-22163380

联系人：宋萍萍

#### （四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所

注册地址：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼（即东三办  
公楼）16 层

法定代表人：葛明

经办注册会计师：李地、周刚

联系人：李妍明

电话：010-58153000

传真：010-85188298

## 六、基金份额的分级

### (一) 基金份额结构

本基金的基金份额包括长城久兆中小板 300 指数证券投资基金之基础份额（简称“久兆 300 份额”）、“久兆稳健份额”与“久兆积极份额”。其中，久兆稳健份额和久兆积极份额的基金份额比例始终保持在 4:6 不变。

### (二) 基金的基本运作概要

1. 本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为久兆 300 份额；场内认购的全部份额将按照 4: 6 的比例确认为久兆稳健份额与久兆积极份额（具体认购方法参见基金份额发售公告）。

2. 本基金基金合同生效后，久兆 300 份额接受场外与场内申购和赎回；久兆稳健份额、久兆积极份额只上市交易，不接受申购和赎回。

3. 本基金基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理久兆 300 份额与久兆稳健份额、久兆积极份额之间的份额配对转换业务。份额配对转换是指本基金场内的久兆 300 份额与久兆稳健份额、久兆积极份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每十份久兆 300 份额的场内份额申请转换成四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额进行配对申请转换成十份久兆 300 份额的场内份额的行为。

4. 本基金基金合同生效后，基金管理人将按照基金合同规定在基金份额折算日对基金份额进行折算，折算后基金运作方式及久兆稳健份额和久兆积极份额配比不变。

### (三) 久兆稳健份额、久兆积极份额概要

#### 1. 存续期限

自基金合同生效之日起存续。

#### 2. 基金份额配比

久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。

#### 3. 久兆稳健份额与久兆积极份额的份额参考净值计算

##### (1) 久兆稳健、久兆积极、久兆 300 份额净值关系

本基金四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额的参考净值之和将等于十份久兆 300 份额的净值。

##### (2) 久兆稳健份额的份额参考净值计算

久兆稳健份额的约定年收益率为 5.8%。久兆稳健份额的约定年收益率除以 365 得到久兆稳健份额的约定日简单收益率。久兆稳健份额的基金份额参考净值以基金合同生效日或前一份额折算日经折算后的份额净值为基准采用久兆稳健份额的约定日简单收益率单利进行计算。久兆稳健份额在估值日应计收益的天数为自基金合同生效日或前一份额折算日（定期份额折算日或不定期份额折算日）次日起至估值日的实际天数。

### （3）久兆积极份额的份额参考净值计算

计算出久兆稳健份额的份额参考净值后，根据久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额净值的关系，可以计算出久兆积极份额的份额参考净值。

### （4）久兆稳健份额与久兆积极份额的份额参考净值公告

久兆稳健份额和久兆积极份额的份额参考净值在当天收市后计算，并在下一日内与本基金份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 4. 定期份额折算

自基金合同生效日或前一定定期份额折算日次日起至满一年的最后一个工作日止，本基金将按照基金合同规定进行基金的定期份额折算。本基金进行定期份额折算后，久兆稳健份额期末的约定应得收益将折算为场内久兆 300 份额分配给久兆稳健份额持有人，久兆稳健份额的份额参考净值调整为 1.000 元；久兆 300 份额持有人持有的每十份久兆 300 份额将按四份久兆稳健份额获得新增久兆 300 份额的分配，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。

经过定期份额折算，久兆 300 份额的份额净值相应进行调整。定期份额折算前后，久兆积极份额的份额参考净值及其份额数未发生变化，久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

## 5. 不定期份额折算

本基金运作期间，如久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元或久兆积极份额的份额参考净值达到 0.250 元，本基金将按照基金合同规定进行基金的不定期份额折算。

当久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。不定期份额折算后，持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应增加，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的

分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。持有人持有的久兆稳健份额和久兆积极份额的份额数在折算前后均保持不变，因折算新增的份额将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

当久兆积极份额的份额参考净值达到 0.250 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元；持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应减少，久兆积极份额持有人持有的久兆积极份额数按照久兆积极份额的折算比例相应减少。为保持久兆稳健份额和久兆积极份额比例不变，久兆稳健份额的折算比例与久兆积极份额相同，久兆稳健份额持有人持有的久兆稳健份额数同比例相应减少，超出份额数将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

不定期份额折算前后，久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

#### 6. 久兆稳健份额与久兆积极份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，久兆稳健份额与久兆积极份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的久兆 300 份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持久兆 300 份额、久兆稳健份额与久兆积极份额表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

## 七、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律、法规及基金合同募集。并经中国证券监督管理委员会 2011 年 9 月 15 日证监许可[2011]1474 号文核准公开募集。

### （一）基金类别、运作方式及存续期间

基金类别：股票型

基金运作方式：契约型开放式

存续期间：不定期

### （二）募集方式和募集场所

基金通过场外、场内两种方式公开发售。

场外发售是指通过基金销售网点(包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点,具体名单见基金份额发售公告或相关业务公告)场外公开发售基金份额的行为。

场内发售是指通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售基金份额的行为(具体名单见本基金份额发售公告或相关业务公告)。本基金认购期结束前获得基金代销业务资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得基金代销资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在久兆稳健份额、久兆积极份额上市后,代理投资人通过深圳证券交易所交易系统参与久兆稳健份额、久兆积极份额的上市交易。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下;通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

本基金发售结束后,投资者场外认购的全部份额将确认为久兆 300 份额;场内认购的全部份额将按 4:6 的比率确认为久兆稳健份额与久兆积极份额。

### （三）募集期限

本基金的募集期限为自基金份额发售之日起不超过 3 个月。

本基金自 2011 年 12 月 19 日到 2012 年 1 月 17 日进行发售。

基金管理人可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

### （四）募集规模

基金募集份额总额不少于 2 亿份,基金募集金额不少于 2 亿元。

基金管理人可根据基金发售情况对本基金的发售进行规模控制,具体规定见基金份额发售公告。

## （五）募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者和机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

## （六）基金份额初始面值

本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元，按初始面值发售。

## （七）投资者对基金份额的认购

### 1. 认购时间安排

本基金的认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续请查阅本基金的基金份额发售公告。

场内认购具体开放时间为深圳证券交易所交易日交易时间，场外认购具体开放时间以各销售机构的规定为准。

### 2. 认购原则

- （1）本基金场外认购采用金额认购方式，场内认购采用份额认购方式；
- （2）投资者认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款；
- （3）投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销，认购费率按每笔认购申请单独计算；
- （4）认购期间单个投资者的累计认购规模没有上限限制；
- （5）销售网点（包括直销机构和代销网点）受理认购申请并不表示对该申请已经成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

### 3. 认购限额

本基金场外认购采用金额认购的方式。在本基金代销机构场外认购时，投资者以金额申请，每个基金账户首笔认购的最低金额为 1,000 元，每笔追加认购的最低金额为 1,000 元。直销机构或各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以其业务规定为准。

本基金场内认购采用份额认购的方式。在具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位场内认购时，投资者以份额申请，单笔最低认购份额为 1,000 份，超过 1,000 份的应为 1,000 份的整数倍，且每笔认购最大不超过 99,999,000 份基金份额。

当发生末日比例配售的情形时，认购申请确认份额不受认购最低限额的限制。

4. 投资人认购应提交的文件和具体的办理手续详见本基金基金份额发售公告和各销售机构的相关业务办理规则。

## （八）认购费用

本基金认购费率如下表所示：

	认购金额（含认购费）	认购费率
场外认购费率	50 万元以下	1.0%
	50 万元(含)－200 万元	0.6%
	200 万元(含)－500 万元	0.3%
	500 万元(含)以上	每笔 1000 元
场内认购费率	由深圳证券交易所会员单位按照场外认购费率设定投资者的场内认购费率。	

本基金的认购费用在投资者认购基金份额时收取。认购费用不列入基金财产，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。投资者可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。募集期间发生的信息披露费、会计师费和律师费等各项费用，不从基金财产中列支。

#### （九）认购份额的计算

##### 1. 场外认购份额的计算

本基金发售结束后，投资者通过场外认购本基金所获得的全部份额将确认为久兆 300 份额。

本基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

对于 500 万元（含）以上的认购，净认购金额 = 认购金额 - 固定认购费金额

例 1：某投资者投资 10 万元认购本基金，对应费率为 1.0%，在募集期间产生利息 50 元，则其可得到的认购份额计算如下：

$$\text{净认购金额} = 100,000.00 / (1 + 1.0\%) = 99,009.90 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000.00 - 99,009.90 = 990.10 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (99,009.90 + 50) / 1.00 = 99,059.90 \text{ 份}$$

即投资者投资 10 万元通过场外认购本基金，加上认购资金在认购期内获得的利息，基金发售结束后，投资者得到的久兆 300 份额为 99,059.90 份。

##### 2. 场内认购金额和利息折算的份额的计算

本基金发售结束后，投资者通过场内认购本基金所获得的全部份额将按 4:6 的比例确认为久兆稳健份额与久兆积极份额。

场内认购采用份额认购方法，计算公式为：

认购金额=挂牌价格×(1+认购费率)×认购份额

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率

净认购金额=挂牌价格×认购份额

利息折算的份额=利息/挂牌价格

认购份额总额=认购份额+利息折算的份额

其中，挂牌价格为基金份额发售面值。

适用固定认购费金额的认购，认购金额=挂牌价格×认购份额+固定认购费金额

### 3. 久兆稳健份额与久兆积极份额的计算

本基金在发售结束后将基金份额持有人场内初始有效认购的总份额按照 4:6 的比例分离成预期收益与风险不同的两个份额类别，即久兆稳健份额和久兆积极份额，久兆稳健份额和久兆积极份额的计算公式如下：

经确认的久兆稳健份额=场内认购份额总额×0.4

经确认的久兆积极份额=场内认购份额总额×0.6

例 2：某投资者认购本基金 10 万份，若会员单位设定认购费率为 1.0%，假定该笔认购产生利息 80 元。则认购金额和利息折算的份额计算如下：

挂牌价格=1.00 元

认购金额=挂牌价格×(1+认购费率)×认购份额

=1.00×(1+1.0%)×100,000=101,000.00 元

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率=1.00×100,000×1.0%=1,000.00 元

净认购金额=挂牌价格×认购份额=1.00×100,000=100,000.00 元

利息折算的份额=利息/挂牌价格=80/1.00=80 份

认购份额总额=100,000+80=100,080 份

经确认的久兆稳健份额=100,080×0.4=40,032 份

经确认的久兆积极份额=100,080×0.6=60,048 份

即：投资者认购 10 万份基金份额，需缴纳 101,000 元，若利息折算的份额为 80 份，则总共可得到 100,080 份基金份额。基金发售结束后，投资者经确认的久兆稳健份额为 40,032 份，久兆积极份额为 60,048 份。

4. 场外认购的久兆 300 份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；场内经确认的久兆稳健份额、久兆积极份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

#### （十）认购的确认

对于 T 日交易时间内受理的认购申请，注册登记机构将在 T+1 日就申请的有效性进行确认。但对申请有效性的确认仅代表确实接受了投资者的认购申请，认购申请的成功确认应以注册登记机构在本基金认购结束后的登记确认结果为准。投资者应在本基金成立后到



各销售网点或以其规定的其他合法方式查询最终确认情况。

（十一）募集资金利息的处理方式

认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。

（十二）募集资金的管理

认购期内，投资者的认购款项只能存入专用账户，不得动用。认购期结束后，由注册登记机构计算投资者认购应获得的基金份额，基金管理人应在 10 日内聘请会计师事务所进行认购款项的验资。

## 八、基金备案与《基金合同》的生效

### （一）基金备案的条件

1. 本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售，且基金募集达到基金备案条件，基金管理人应当自基金募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

2. 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3. 本基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### （二）基金募集失败

1. 基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基金募集失败。

2. 如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后 30 日内退还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

3. 如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 九、久兆 300 份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回场所

投资者办理久兆 300 份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司（深圳）开放式基金账户办理久兆 300 份额场外申购、赎回业务。

投资者办理久兆 300 份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理久兆 300 份额场内申购、赎回业务。其中，深圳证券账户是指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股股票账户或证券投资基金账户。

本基金场外、场内代销机构名单将由基金管理人在发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；
4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1. 申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的任何损失由投资者自行承担。

##### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

#### （五）申购和赎回的数额限制

1. 每笔申购申请不得低于1000元(含申购费)。本基金定期定额投资不受此最低申购金额限制。

2. 基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不受限制。投资者每个交易账户不设最低基金份额余额限制。

3. 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 本基金的申购采用“金额申购”方式，申购价格以申购当日久兆 300 份额的基金份额净值为基准进行计算；本基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日久兆 300 份额的基金份额净值为基准进行计算。

#### 2. 申购费率

本基金申购费由投资者承担，在申购基金份额时收取，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用，不列入基金财产。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

	申购金额（含申购费）	申购费率
场外申购费率	50 万元以下	1.2%
	50 万元(含)－200 万元	0.8%
	200 万元(含)－500 万元	0.4%
	500 万元(含)以上	每笔 1000 元
场内申购费率	由深圳证券交易所会员单位按照场外申购费率设定投资者的场内申购费率。	

#### 3. 赎回费率

本基金的赎回费由基金份额持有人承担，在赎回基金份额时收取，其中 25% 归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费和其他手续费。

	持有年限	赎回费率
场外赎回费率	1 年以内	0.5%
	1 年(含)－2 年	0.25%
	2 年(含)以上	0%
场内赎回费率	0.5%	

4. 基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、收费方式或调低赎回费率。费率或收费方式如发生变更，基金管理人应在调整实施前按照《信息披露办法》有关规定至少在一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

5. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定

基金促销计划，针对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率。

### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

#### 1. 久兆 300 份额申购份额的计算及余额的处理方式

久兆 300 份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

申购金额在 500 万元(含)以上的适用固定金额的申购费，即净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日久兆 300 基金份额净值}$$

通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；通过场内方式申购的，申购份额计算结果保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例 3：某投资者通过场外投资 10 万元申购久兆 300 份额，申购费率为 1.2%，假定申购当日久兆 300 份额的基金份额净值为 1.100 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.100 = 89,831.12 \text{ 份}$$

例 4：如例 3，如果该投资者选择通过场内申购，假定申购费率也为 1.2%，则因场内份额保留至整数位，故投资者申购所得份额为 89,831 份，不足 1 份部分对应的申购资金返还给投资者。计算方法如下：

$$\text{实际净申购金额} = 89,831 \times 1.100 = 98,814.10 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,814.10 - 1185.77 = 0.13 \text{ 元}$$

#### 2. 久兆 300 份额的赎回金额的计算及处理方式

本基金的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日久兆 300 份额的基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例 5：某投资者赎回 10 万份久兆 300 份额，持有时间为 8 个月，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日久兆 300 份额的基金份额净值是 1.100 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.100 = 110,000 \text{ 元}$$

赎回费用=110,000×0.5%=550 元

净赎回金额=110,000-550=109,450 元

3. 久兆 300 份额的份额净值计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人对久兆 300 份额的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况。
4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
5. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
6. 基金合同、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的久兆 300 份额的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 基金合同、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在久兆 300 份额暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的

办理并予以公告。

#### (十) 巨额赎回的情形及处理方式

##### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内久兆 300 份额的净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额(包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额)的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权，并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所相关规则进行处理；基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关业务规则及届时开展转换业务的公告。

(3) 暂停赎回：久兆 300 份额连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受久兆 300 份额的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

##### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

#### (十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登久兆 300



份额重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上刊登久兆 300 份额重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日久兆 300 份额的基金份额净值。

#### （十二）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办久兆 300 份额与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### （十三）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

#### （十四）定期定额投资

基金管理人可以为投资人办理久兆 300 份额的定期定额投资计划，具体规则由基金管理人届时发布公告或在更新的招募说明书中确定。投资人在办理久兆 300 份额的定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### （十五）基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 十、久兆稳健份额与久兆积极份额的上市交易

本基金基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请久兆稳健份额、久兆积极份额上市交易。

### (一) 上市交易的地点

深圳证券交易所。

### (二) 上市交易的时间

在符合下述第（三）项规定的基金上市条件的前提下，久兆稳健份额和久兆积极份额拟在基金合同生效后三个月内，申请在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一家指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

### (三) 基金上市的条件

如基金具备下列条件，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》向深圳证券交易所申请上市交易。

1. 基金募集金额不低于 2 亿元。
2. 基金份额持有人不少于 1000 人。
3. 《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。

### (四) 上市交易的规则

1. 久兆稳健份额、久兆积极份额分别采用不同的交易代码上市交易。
2. 久兆稳健份额、久兆积极份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一工作日的基金份额净值。
3. 久兆稳健份额、久兆积极份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行。
4. 久兆稳健份额、久兆积极份额买入申报数量为 100 份或其整数倍。
5. 久兆稳健份额、久兆积极份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币。
6. 久兆稳健份额、久兆积极份额上市交易的其他规则遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定。

### (五) 上市交易的费用

久兆稳健份额、久兆积极份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

### (六) 上市交易的行情揭示

久兆稳健份额、久兆积极份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系

统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额净值。

(七) 上市交易的注册登记

投资人 T 日买入成功后，注册登记机构在 T 日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自 T+1 日（含该日）后有权卖出该部分基金；

投资人 T 日卖出成功后，注册登记机构在 T 日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

(八) 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

久兆稳健份额、久兆积极份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

(九) 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

(十) 若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当程序后增加相应功能。

## 十一、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记等其他相关业务

### （一）基金份额的登记

1. 本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购或通过跨系统转登记从场内转入的久兆 300 份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；久兆稳健份额、久兆积极份额，以及场内认购、申购或通过跨系统转登记从场外转入的久兆 300 份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

2. 登记在证券登记结算系统中的久兆 300 份额可以申请场内赎回；登记在注册登记系统中的久兆 300 份额可以申请场外赎回。

3. 登记在证券登记结算系统中的久兆稳健份额、久兆积极份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。

### （二）系统内转托管

1. 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2. 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理久兆 300 份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有久兆 300 份额的系统内转托管。

3. 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理久兆稳健份额、久兆积极份额上市交易或久兆 300 份额场内赎回业务的会员单位（席位）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4. 投资者采用基金管理人直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额将不能办理系统内转托管业务。若网上交易有关规定及业务规则发生变更，基金管理人可为投资者采用直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额办理系统内转托管时，基金管理人将做出调整并及时公告。

5. 募集期内不得办理系统内转托管。

6. 基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

### （三）跨系统转登记

1. 跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的久兆 300 份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2. 久兆 300 份额跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

3. 投资者采用基金管理人直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额将不能办理跨系统转登记业务。若网上交易有关规定及业务规则发生变更，基金管理人可为投资者采用直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额办理跨系统转登记时，基金管理人将做出调整并及时公告。

4. 募集期内不得办理跨系统转登记。
5. 基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

（四）基金份额的非交易过户、质押、冻结与解冻

本基金的非交易过户、质押、冻结与解冻等，按照中国证券登记结算有限责任公司、深圳证券交易所等相关机构的规定办理。

## 十二、基金的份额配对转换

本基金基金合同生效后，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

### （一）份额配对转换

份额配对转换是指本基金场内的久兆 300 份额与久兆稳健份额、久兆积极份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面。

1. 分拆。基金份额持有人将其持有的每十份久兆 300 份额的场内份额申请转换成四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额的行为。

2. 合并。基金份额持有人将其持有的四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额进行配对申请转换成十份久兆 300 份额的场内份额的行为。

### （二）份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、基金登记结算机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

### （三）份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自久兆稳健份额、久兆积极份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前 2 日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体业务办理时间见招募说明书。在招募说明书规定的上述时间之外不办理份额配对转换业务。

若深圳证券交易所交易时间、交易规则更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

### （四）份额配对转换的原则

1. 份额配对转换以份额申请。

2. 申请进行“分拆”的久兆 300 份额的场内份额必须是 10 的整数倍。

3. 申请进行“合并”的久兆稳健份额与久兆积极份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且两者的比例为 4:6。

4. 久兆 300 份额的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转登记为久兆 300 份额的场内份额后方可进行。

5. 份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

深圳证券交易所、基金登记结算机构或基金管理人可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前 2 日在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。

（五）份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

（六）暂停份额配对转换的情形

1. 深圳证券交易所、基金登记结算机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

2. 法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

（七）份额配对转换的业务办理费用

份额配对转换业务办理机构可对份额配对转换业务的办理酌情收取一定的佣金，具体见相关业务公告。

## 十三、基金的投资管理

### （一）投资目标

本基金通过投资约束和数量化监控，力求实现对中小板 300（价格）指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率之间的日平均跟踪误差控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。

### （二）投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、资产支持证券、权证，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，进行组合资产管理。

### （三）投资策略

本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。

#### 1. 资产配置策略

为了实现跟踪误差最小化，本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股。本基金将采用完全复制策略，按标的指数成份股及其权重构建股票资产组合。

#### 2. 股票投资策略

本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资，根据中小板 300（价格）指数成份股的基准权重构建股票资产组合，并根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。

##### （1）股票投资组合的构建

本基金将按照中小板 300（价格）指数各成份股的基准权重进行股票资产配置。当遇到成份股停牌、流动性不足、投资限制或其他影响指数复制的市场因素，使基金无法依指数权重购买某成份股或预期将调整的标的指数成份股时，本基金可以根据市场情况，对基金资产进行适当调整，以尽量缩小跟踪误差。



## （2）股票投资组合的调整

本基金的股票投资组合将根据中小板 300（价格）指数成份股构成及其权重的变动进行相应的定期调整和日常修正，本基金还将根据投资比例限制、申购赎回变动情况等因素，对股票投资组合进行不定期调整，力争实现跟踪误差最小化。

### 1) 定期调整

本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。中小板 300 指数的样本股每半年调整一次，每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%。样本调整设置缓冲区，排名在样本数 70%范围内的非原成份股按顺序入选，排名在样本数 130%范围内的原成份股按顺序优先保留。

本基金将持续关注中小板 300 指数成份股的变动情况，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，实现指数调整前后基金资产稳定，减小基金资产波动对跟踪误差造成的影响。

### 2) 不定期调整

①当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据其需调整的权重比例，进行相应调整。

②当上市公司股权关系发生变动导致其控股属性发生变化或者指数成份股出现吸收合并等事件时，本基金可根据市场情况，对基金资产进行适当调整，以尽量缩小跟踪误差。

③本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略对股票投资组合进行调整，使基金申购和赎回不会对跟踪误差带来重大影响。

④若因个别成份股停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得本基金无法按照其所占标的指数权重进行购买时，本基金将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，部分持有现金或买入相关的替代性组合。

进行股票替换时遵循的原则如下：①用以替换的股票与被替换股票属于同一行业；②用以替换的股票具有较好的流动性；③用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考察期内日收益率序列风险收益特征高度相关，能较好地代表被替代股票的收益率及其波动情况。

### 3. 债券投资策略

本基金将根据“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，重点参考基金的流动性管理需要，选取流动性较好的债券进行配置。

### 4. 权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

此外，本基金还将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股）。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，进行组合资产管理。

#### （四）业绩比较基准

本基金以中小板 300（价格）指数作为标的指数。

本基金业绩比较基准：中小板 300（价格）指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

由于本基金为完全复制型指数基金，跟踪标的为中小板 300（价格）指数，同时本基金现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金以中小板 300（价格）指数收益率和活期存款利率（税后）的复合收益率作为基金的业绩比较基准符合本基金的特性。

今后，如果指数公司变更或停止中小板 300（价格）指数的编制及发布，或中小板 300（价格）指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中小板 300（价格）指数不宜继续作为标的指数，或市场有其他更适合投资的指数，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更本基金的标的指数和投资对象，并选择确定新的标的指数，相应变更基金名称、投资范围和业绩比较基准或业绩比较基准的权重构成。本基金由于上述原因变更标的指数和投资对象以及相应变更基金名称、投资范围和业绩比较基准或业绩比较基准的权重构成，不需召开基金持有人大会通过，但须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在报中国证监会备案后及时公告。

#### （五）风险收益特征

本基金为指数型基金，长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等，为高风险、高收益产品。

#### （六）投资决策依据及程序

##### 1. 决策依据

- (1) 国家有关法律、法规以及基金合同等的有关规定。
- (2) 《长城基金管理有限公司章程》的有关规定。
- (3) 《长城基金管理有限公司投资管理制度》的有关规定。

##### 2. 投资决策程序

(1) 本基金的投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，投资决策委员会是基金投资的最高决策机构。投资决策委员会根据中国证监会《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规和各基金合同、公司的有关规章制度，确定公司投资战略和投资方向，制订重大投资决策。

(2) 基金经理根据投资决策委员会的投资战略，结合对指数成份股、证券市场、投资时机等方面的分析，拟订基金的具体投资计划。

(3) 投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。

(4) 根据决策纪要，基金经理构造具体的投资组合及操作方案，交由交易室执行。

(5) 投资决策委员会定期（月）召开会议，评价基金净值与比较基准的跟踪误差，并对基金管理小组关于控制跟踪误差的提案做出决议。

(6) 基金管理部基金管理小组利用数量模型，对总体累积偏差和行业偏差进行测算；研究部行业研究小组从基本面对行业、个股和市场走势提供基本信息，提示风险；运行保障部提供基金申购、赎回的动态情况，供基金管理小组参考。

(7) 基金管理小组根据信息汇总情况对组合进行适度调整，对于需调整的个股，基金经理必须提供充分的理由。

(8) 研究部金融工程小组对基金投资组合跟踪误差进行评估，并作出跟踪误差的归因分析报告，在投资组合的年化总体累积偏差超过 2% 时提出预警。

(9) 监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。

(10) 交易室按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理。

## （七）投资限制

### 1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90% 的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

(2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%。

(3) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金管理人管理的全部基金持有同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

(4) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(5) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%。

(6) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交

易日内进行调整。

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基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## （八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
3. 有利于基金财产的安全与增值；
4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## （九）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 十四、基金的财产

### (一)基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### (二)基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### (三)基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### (四)基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十五、基金资产的估值

### (一) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### (二) 估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (三) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (四) 基金份额净值的计算

本基金分别计算并公告久兆300份额的基金份额净值以及久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值。

#### 1. 久兆300份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

久兆300份额的基金份额净值计算公式为：

$T$  日久兆300份额的基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日本基金（包括久兆300份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）的基金份额余额总数

#### 2. 久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值计算

(1) 本基金四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额的参考净值之和将等于十份久兆300份额的净值。

(2) 久兆稳健份额的约定收益率为5.8%。久兆稳健份额的约定收益率除以365得到久兆稳健份额的约定日简单收益率。久兆稳健份额的基金份额参考净值以基金合同生效日或前一份额折算日经折算后的份额净值为基准采用久兆稳健份额的约定日简单收益率单利进

行计算。久兆稳健份额在估值日应计收益的天数为自基金合同生效日或前一份额折算日（定期份额折算日或不定期份额折算日）次日起至估值日的实际天数。

（3）计算出久兆稳健份额的份额参考净值后，根据久兆稳健份额、久兆积极份额和久兆300份额净值的关系，计算出久兆积极份额的份额参考净值。

（4）本基金进行定期份额折算或不定期份额折算操作以后，久兆稳健份额、久兆积极份额的份额参考净值计算方法保持不变。

（5）久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值计算公式

$$NAV_T^{\text{稳健}} = 1.000 + 1.000 \times \left( \frac{5.8\%}{365} \times t \right)$$

$$NAV_T^{\text{积极}} = \left( NAV_T^{300} - 0.4 \times NAV_T^{\text{稳健}} \right) / 0.6$$

其中， $T$ 表示估值日； $t$ 表示久兆稳健份额在估值日应计收益的天数， $t = \min(\text{基金合同生效日至估值日的实际天数}, \text{前一定定期份额折算日次日起至估值日的实际天数}, \text{前一定不定期份额折算日次日起至估值日的实际天数})$ ； $NAV_T^{\text{稳健}}$ 、 $NAV_T^{\text{积极}}$ 分别表示久兆稳健份额与久兆积极份额在 $T$ 日的基金份额参考净值； $NAV_T^{300}$ 表示久兆300份额在 $T$ 日的基金份额净值。

例6：假设 $t = 300$ ， $NAV_T^{300} = 1.800$ ，则

$$NAV_T^{\text{稳健}} = 1.000 + 1.000 \times \left( \frac{5.8\%}{365} \times 300 \right) = 1.048$$

$$NAV_T^{\text{积极}} = (1.800 - 0.4 \times 1.048) / 0.6 = 2.301$$

#### （五）估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：



## 1. 差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的,由差错责任方对直接损失承担赔偿责任;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则差错责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受

的直接损失。

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1)查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4)根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1)基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2)错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告。

(3)因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### (七) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；

4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### (八) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

### (九) 特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第5项进行估值时，所造成的误差不作为基金

资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十六、基金的收益分配

### (一) 基金收益的构成

本基金合同项下基金收益即基金利润，指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### (二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### (三) 收益分配原则

本基金（包括久兆300份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后如果终止久兆稳健份额与久兆积极份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 十七、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金上市费及年费；
9. 标的指数许可使用费；
10. 基金收益分配中发生的费用；
11. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 3. 基金合同生效后的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的《指数使用许可协议》的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用许可费。指数使用许可费的计费时间从本基金基金合同生效日开始计算；基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度5万元。

在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。当本基金在某个季度的指数使用许可费不足5万元时，由于指数使用许可费收取下限的存在，本基金在该季度实际的指数使用许可费年费率将高于0.02%。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。

指数使用许可费计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应付的指数使用许可费

E为前一日的基金资产净值

4. 除管理费、托管费、标的指数使用许可费和前述十七（一）所列之外的基金费用，由基金托管人与基金管理人协商后，根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十八、基金份额折算

自基金合同生效日或前一定定期份额折算日次日起至满一年的最后一个工作日止，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。本基金运作期间，如久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元或久兆积极份额的份额参考净值达到 0.250 元，本基金将按照以下规则进行基金的不定期份额折算。

### （一）定期份额折算

#### 1. 定期份额折算的折算日

每个基金运作周年的最后一个工作日。

运作周年指自基金合同生效日或前一定定期份额折算日次日起至满一年的运作期间。若该运作期间的最后一日为工作日，则该运作期间的最后一日为定期份额折算的折算日。若该运作期间的最后一日为非工作日，则定期份额折算的折算日为该日之前的最后一个工作日。

例如，假设本基金成立于 2011 年 7 月 14 日（周四），则本基金成立后的第一个运作周年的运作期间为 2011 年 7 月 14 日至 2012 年 7 月 13 日。假设 2012 年 7 月 13 日（周五）为工作日，则本基金第一个运作周年的定期份额折算的折算日为 2012 年 7 月 13 日。第二个运作周年的运作期间为 2012 年 7 月 14 日至 2013 年 7 月 13 日。假设 2013 年 7 月 13 日（周六）为非工作日，该日之前的最后一个工作日为 2013 年 7 月 12 日（周五），则本基金第二个运作周年的定期份额折算的折算日为 2013 年 7 月 12 日。第三个运作周年的运作期间为 2013 年 7 月 13 日至 2014 年 7 月 12 日。假设 2014 年 7 月 12 日（周六）为非工作日，该日之前的最后一个工作日为 2014 年 7 月 11 日（周五），则本基金第三个运作周年的定期份额折算的折算日为 2014 年 7 月 11 日。以此类推。

#### 2. 定期份额折算的折算对象

定期份额折算的折算日登记在册的久兆 300 份额和久兆稳健份额。

#### 3. 定期份额折算的折算频率

每年折算一次。

#### 4. 定期份额折算的折算方式

本基金进行定期份额折算后，久兆稳健份额期末的约定应得收益将折算为场内久兆 300 份额分配给久兆稳健份额持有人，久兆稳健份额的份额参考净值调整为 1.000 元；久兆 300 份额持有人持有的每十份久兆 300 份额将按四份久兆稳健份额获得新增久兆 300 份额的分配，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。

经过定期份额折算，久兆 300 份额的份额净值相应进行调整。定期份额折算前后，久兆积极份额的份额参考净值及其份额数未发生变化，久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

#### （1）久兆 300 份额

$$NAV_{后}^{300} = NAV_{前}^{300} - 0.4 \times (NAV_{前}^{稳健} - 1.000)$$

$$\text{久兆 300 份额持有人新增的久兆 300 份额数} = \frac{0.4 \times (NAV_{前}^{\text{稳健}} - 1.000) \times NUM_{前}^{300}}{NAV_{后}^{300}}$$

$$NUM_{后}^{300} = NUM_{前}^{300} + \text{久兆 300 份额持有人新增的久兆 300 份额数}$$

$$= NUM_{前}^{300} + \frac{0.4 \times (NAV_{前}^{\text{稳健}} - 1.000) \times NUM_{前}^{300}}{NAV_{后}^{300}}$$

其中， $NAV_{前}^{300}$  表示定期份额折算前久兆 300 份额的份额净值； $NAV_{后}^{300}$  表示定期份额折算后久兆 300 份额的份额净值； $NAV_{前}^{\text{稳健}}$  表示定期份额折算前久兆稳健份额的份额参考净值； $NUM_{前}^{300}$  表示定期份额折算前久兆 300 份额持有人持有的久兆 300 份额数； $NUM_{后}^{300}$  表示定期份额折算后久兆 300 份额持有人持有的久兆 300 份额数。

久兆 300 份额定期份额折算后，场外久兆 300 份额折算保留至小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差归入基金资产；场内久兆 300 份额折算保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

### (2) 久兆稳健份额

$$NAV_{后}^{\text{稳健}} = \frac{NAV_{前}^{\text{稳健}} \times NUM_{前}^{\text{稳健}} - \text{期末的约定应得收益}}{NUM_{后}^{\text{稳健}}} = 1.000, \quad NUM_{后}^{\text{稳健}} = NUM_{前}^{\text{稳健}}$$

$$\text{久兆稳健份额持有人新增的场内久兆 300 份额的份额数} = \frac{\text{期末的约定应得收益}}{NAV_{后}^{300}}$$

$$= \frac{(NAV_{前}^{\text{稳健}} - NAV_{后}^{\text{稳健}}) \times NUM_{前}^{\text{稳健}}}{NAV_{后}^{300}}$$

其中， $NAV_{前}^{\text{稳健}}$  表示定期份额折算前久兆稳健份额的份额参考净值； $NAV_{后}^{\text{稳健}}$  表示定期份额折算后久兆稳健份额的份额参考净值； $NAV_{后}^{300}$  表示定期份额折算后久兆 300 份额的份额净值； $NUM_{前}^{\text{稳健}}$  表示定期份额折算前久兆稳健份额持有人持有的久兆稳健份额数； $NUM_{后}^{\text{稳健}}$  表示定期份额折算后久兆稳健份额持有人持有的久兆稳健份额数。

久兆稳健份额定期份额折算后，久兆稳健份额持有人新增的场内久兆 300 份额的份额数折算保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

### (3) 久兆积极份额

定期份额折算不改变久兆积极份额的份额参考净值及其份额数，久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比在定期份额折算前后始终保持 4:6 的比例不变。

例 7：假设某定期份额折算前，久兆 300 份额的份额净值为 1.300 元，久兆稳健份额的份额参考净值为 1.058 元，久兆积极份额的份额参考净值为 1.461 元；定期份额折算前，场外久兆 300 份额为 10 亿份，场内久兆 300 份额为 5 亿份，久兆稳健份额为 20 亿份，久兆积极份额为 30 亿份。则定期份额折算后，

#### (1) 久兆 300 份额

$$NAV_{后}^{300} = NAV_{前}^{300} - 0.4 \times (NAV_{前}^{\text{稳健}} - 1.000) = 1.300 - 0.4 \times (1.058 - 1.000) = 1.277 \text{ 元}$$



场外久兆 300 份额持有人新增的场外久兆 300 份额数

$$= \frac{0.4 \times (NAV_{前}^{稳健} - 1.000) \times NUM_{前}^{300}}{NAV_{后}^{300}} = \frac{0.4 \times (1.058 - 1.000) \times 10 \text{亿}}{1.277} = 18,167,580.27 \text{份}$$

场内久兆 300 份额持有人新增的场内久兆 300 份额数

$$= \frac{0.4 \times (NAV_{前}^{稳健} - 1.000) \times NUM_{前}^{300}}{NAV_{后}^{300}} = \frac{0.4 \times (1.058 - 1.000) \times 5 \text{亿}}{1.277} = 9,083,790.13 \text{份}$$

取整后为 9,083,790 份。

定期份额折算后场外久兆 300 份额持有人持有的场外久兆 300 份额数=定期份额折算前场外久兆 300 份额持有人持有的场外久兆 300 份额数+久兆 300 份额持有人新增的场外久兆 300 份额数=1,000,000,000+18,167,580.27=1,018,167,580.27 份

定期份额折算后场内久兆 300 份额持有人持有的场内久兆 300 份额数=定期份额折算前场内久兆 300 份额持有人持有的场内久兆 300 份额数+久兆 300 份额持有人新增的场内久兆 300 份额数=500,000,000+9,083,790=509,083,790 份

## (2) 久兆稳健份额

$$NAV_{后}^{稳健} = \frac{NAV_{前}^{稳健} \times NUM_{前}^{稳健} - \text{期末的约定应得收益}}{NUM_{前}^{稳健}} = 1.000 \text{元}$$

定期份额折算后久兆稳健份额持有人持有的久兆稳健份额数=  $NUM_{前}^{稳健} = 20 \text{亿份}$

$$\begin{aligned} \text{久兆稳健份额持有人新增的场内久兆 300 份额的份额数} &= \frac{\text{期末的约定应得收益}}{NAV_{后}^{300}} \\ &= \frac{(NAV_{前}^{稳健} - NAV_{后}^{稳健}) \times NUM_{前}^{稳健}}{NAV_{后}^{300}} = \frac{(1.058 - 1.000) \times 20 \text{亿}}{1.277} = 90,837,901.33 \text{份} \end{aligned}$$

取整后为 90,837,901 份。

## (3) 久兆积极份额

定期份额折算不改变久兆积极份额的份额参考净值及其份额数。定期份额折算后，久兆积极份额参考净值仍为 1.461 元，久兆积极份额持有人持有的久兆积极份额仍为 30 亿份，久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比在定期份额折算前后始终保持 4:6 的比例不变。

## 5. 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停久兆稳健份额的上市交易和久兆 300 份额的申购、赎回或配对转换等业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 6. 定期份额折算结果的公告

本基金定期份额折算结束后，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 7. 特殊情形的处理

若在某定期份额折算的折算日发生合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，本基金将按照不定期份额折算的规则进行份额折算。

## （二）不定期份额折算

### 1. 不定期份额折算的折算日

本基金运作期间，如久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元或久兆积极份额的份额参考净值达到 0.250 元，本基金将进行基金的不定期份额折算，基金管理人可根据市场情况确定不定期份额折算的折算日。

### 2. 不定期份额折算的折算对象

不定期份额折算的折算日登记在册的久兆 300 份额、久兆稳健份额和久兆积极份额。

### 3. 不定期份额折算的折算频率

不定期。

### 4. 不定期份额折算的折算方式

#### （1）当久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元时

当久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。不定期份额折算后，持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应增加，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。持有人持有的久兆稳健份额和久兆积极份额的份额数在折算前后均保持不变，因折算新增的份额将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

不定期份额折算前后，久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

#### 1) 久兆 300 份额

$$NAV_{后}^{300} = 1.000, \quad NUM_{后}^{300} = \frac{NAV_{前}^{300} \times NUM_{前}^{300}}{1.000}$$

其中， $NAV_{前}^{300}$  表示不定期份额折算前久兆 300 份额的份额净值； $NAV_{后}^{300}$  表示不定期份额折算后久兆 300 份额的份额净值； $NUM_{前}^{300}$  表示不定期份额折算前久兆 300 份额的份额数； $NUM_{后}^{300}$  表示不定期份额折算后久兆 300 份额的份额数。

久兆 300 份额不定期份额折算后，场外久兆 300 份额折算保留至小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差归入基金资产；场内久兆 300 份额折算保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

#### 2) 久兆稳健份额和久兆积极份额

$$NAV_{后}^{稳健} = NAV_{后}^{积极} = 1.000, \quad NUM_{后}^{稳健} = NUM_{前}^{稳健}, \quad NUM_{后}^{积极} = NUM_{前}^{积极}$$

$$\text{久兆稳健份额新增份额折算成场内久兆 300 份额的份额数} = \frac{(NAV_{前}^{稳健} - 1.000) \times NUM_{前}^{稳健}}{1.000}$$

$$\text{久兆积极份额新增份额折算成场内久兆 300 份额的份额数} = \frac{(NAV_{前}^{积极} - 1.000) \times NUM_{前}^{积极}}{1.000}$$

其中， $NAV_{前}^{稳健}$  表示不定期份额折算前久兆稳健份额的份额参考净值； $NAV_{前}^{积极}$  表示不定期份额折算前久兆积极份额的份额参考净值； $NAV_{后}^{稳健}$  表示不定期份额折算后久兆稳健份额的份额参考净值；

$NAV_{后}^{积极}$  表示不定期份额折算后久兆积极份额的份额参考净值； $NUM_{前}^{稳健}$  表示不定期份额折算前久兆稳健份额的份额数； $NUM_{前}^{积极}$  表示不定期份额折算前久兆积极份额的份额数； $NUM_{后}^{稳健}$  表示不定期份额折算后久兆稳健份额的份额数； $NUM_{后}^{积极}$  表示不定期份额折算后久兆积极份额的份额数。

久兆稳健份额或久兆积极份额不定期份额折算后，因折算新增的场内久兆 300 份额的份额数折算保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

(2) 当久兆积极份额的份额参考净值达到 0.250 元时

当久兆积极份额的份额参考净值达到 0.250 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元；持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应减少，久兆积极份额持有人持有的久兆积极份额数按照久兆积极份额的折算比例相应减少。为保持久兆稳健份额和久兆积极份额比例不变，久兆稳健份额的折算比例与久兆积极份额相同，久兆稳健份额持有人持有的久兆稳健份额数同比例相应减少，超出份额数将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

不定期份额折算前后，久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

1) 久兆 300 份额

$$NAV_{后}^{300} = 1.000, \quad NUM_{后}^{300} = \frac{NAV_{前}^{300} \times NUM_{前}^{300}}{1.000}$$

其中， $NAV_{前}^{300}$  表示不定期份额折算前久兆 300 份额的份额净值； $NAV_{后}^{300}$  表示不定期份额折算后久兆 300 份额的份额净值； $NUM_{前}^{300}$  表示不定期份额折算前久兆 300 份额的份额数； $NUM_{后}^{300}$  表示不定期份额折算后久兆 300 份额的份额数。

久兆 300 份额不定期份额折算后，场外久兆 300 份额折算保留至小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差归入基金资产；场内久兆 300 份额折算保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

2) 久兆稳健份额和久兆积极份额

$$NAV_{后}^{稳健} = NAV_{后}^{积极} = 1.000, \quad NUM_{后}^{稳健} = \frac{4}{6} \times NUM_{后}^{积极} = \frac{4}{6} \times \frac{NAV_{前}^{积极} \times NUM_{前}^{积极}}{1.000}$$

久兆稳健份额持有人新增的场内久兆 300 份额的份额数

$$= \frac{(NAV_{前}^{稳健} \times NUM_{前}^{稳健} - 1.000 \times NUM_{后}^{稳健})}{1.000}$$

其中， $NAV_{前}^{稳健}$  表示不定期份额折算前久兆稳健份额的份额参考净值； $NAV_{前}^{积极}$  表示不定期份额折算前久兆积极份额的份额参考净值； $NAV_{后}^{稳健}$  表示不定期份额折算后久兆稳健份额的份额参考净值； $NAV_{后}^{积极}$  表示不定期份额折算后久兆积极份额的份额参考净值； $NUM_{前}^{稳健}$  表示不定期份额折算前久兆稳健份额的份额数； $NUM_{前}^{积极}$  表示不定期份额折算前久兆积极份额的份额数； $NUM_{后}^{稳健}$  表示不定期份额折算后久兆稳健份额的份额数； $NUM_{后}^{积极}$  表示不定期份额折算后久兆积极份额的份额数。

久兆稳健份额不定期份额折算后，因折算新增的场内久兆 300 份额的份额数折算保留至整数（最小单

位为 1 份)，余额计入基金资产。

例 8：（1）假设某日久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元，触发不定期份额折算。该次不定期份额折算前，久兆 300 份额的份额净值为 2.010 元，久兆稳健份额的份额参考净值为 1.020 元，久兆积极份额的份额参考净值为 2.670 元；不定期份额折算前，场外久兆 300 份额为 10 亿份，场内久兆 300 份额为 5 亿份，久兆稳健份额为 20 亿份，久兆积极份额为 30 亿份。则不定期份额折算后，

1) 久兆 300 份额

$$NAV_{后}^{300} = 1.000 \text{ 元}$$

$$\text{不定期份额折算后场外久兆 300 份额的份额数} = \frac{NAV_{前}^{300} \times NUM_{前}^{300}}{1.000} = \frac{2.010 \times 10 \text{ 亿}}{1.000} = 2,010,000,000.00 \text{ 份}$$

$$\text{不定期份额折算后场内久兆 300 份额的份额数} = \frac{NAV_{前}^{300} \times NUM_{前}^{300}}{1.000} = \frac{2.010 \times 5 \text{ 亿}}{1.000} = 1,005,000,000 \text{ 份}$$

（2）久兆稳健份额和久兆积极份额

$$NAV_{后}^{\text{稳健}} = NAV_{后}^{\text{积极}} = 1.000 \text{ 元}, \quad NUM_{后}^{\text{稳健}} = NUM_{前}^{\text{稳健}} = 20 \text{ 亿份}, \quad NUM_{后}^{\text{积极}} = NUM_{前}^{\text{积极}} = 30 \text{ 亿份}$$

久兆稳健份额新增份额折算成场内久兆 300 份额的份额数

$$= \frac{(NAV_{前}^{\text{稳健}} - 1.000) \times NUM_{前}^{\text{稳健}}}{1.000} = \frac{(1.020 - 1.000) \times 20 \text{ 亿}}{1.000} = 40,000,000 \text{ 份}$$

久兆积极份额新增份额折算成场内久兆 300 份额的份额数

$$= \frac{(NAV_{前}^{\text{积极}} - 1.000) \times NUM_{前}^{\text{积极}}}{1.000} = \frac{(2.670 - 1.000) \times 30 \text{ 亿}}{1.000} = 5,010,000,000 \text{ 份}$$

（2）假设某日久兆积极份额的份额参考净值低于 0.250 元，触发不定期份额折算。该次不定期份额折算前，久兆 300 份额的份额净值为 0.560 元，久兆稳健份额的份额参考净值为 1.030 元，久兆积极份额的份额参考净值为 0.247 元；不定期份额折算前，场外久兆 300 份额为 10 亿份，场内久兆 300 份额为 5 亿份，久兆稳健份额为 20 亿份，久兆积极份额为 30 亿份。

则不定期份额折算后，

1) 久兆 300 份额

$$NAV_{后}^{300} = 1.000 \text{ 元}$$

$$\text{不定期份额折算后场外久兆 300 份额的份额数} = \frac{NAV_{前}^{300} \times NUM_{前}^{300}}{1.000} = \frac{0.560 \times 10 \text{ 亿}}{1.000} = 560,000,000.00 \text{ 份}$$

$$\text{不定期份额折算后场内久兆 300 份额的份额数} = \frac{NAV_{前}^{300} \times NUM_{前}^{300}}{1.000} = \frac{0.560 \times 5 \text{ 亿}}{1.000} = 280,000,000 \text{ 份}$$

（2）久兆稳健份额和久兆积极份额

$$NAV_{后}^{\text{稳健}} = NAV_{后}^{\text{积极}} = 1.000 \text{ 元}$$

$$NUM_{后}^{积极} = \frac{NAV_{前}^{积极} \times NUM_{前}^{积极}}{1.000} = \frac{0.247 \times 30 \text{亿}}{1.000} = 741,000,000 \text{ 份}$$

$$NUM_{后}^{稳健} = \frac{4}{6} \times NUM_{后}^{积极} = \frac{4}{6} \times 741,000,000 = 494,000,000 \text{ 份}$$

久兆稳健份额持有人新增的场内久兆 300 份额的份额数

$$= \frac{(NAV_{前}^{稳健} \times NUM_{前}^{稳健} - 1.000 \times NUM_{后}^{稳健})}{1.000} = \frac{(1.030 \times 20 \text{亿} - 1.000 \times 4.94 \text{亿})}{1.000} = 1,566,000,000 \text{ 份}$$

#### 5. 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规定暂停久兆稳健份额与久兆积极份额的上市交易和久兆 300 份额的申购、赎回或配对转换等业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6. 不定期份额折算的公告

(1) 本基金运作期间，如果久兆 300 份额的份额净值在某一开放日小于或等于 1.800 元，但在下一开放日大于 1.800 元，基金管理人将就基金实施不定期份额折算的可能性及有关事项在至少一家指定媒体和基金管理人网站进行提示性公告。

(2) 本基金运作期间，如果久兆积极份额的份额参考净值在某一开放日大于或等于 0.350 元，但在下一开放日小于 0.350 元，基金管理人将就基金实施不定期份额折算的可能性及有关事项在至少一家指定媒体和基金管理人网站进行提示性公告。

(3) 本基金运作期间，如久兆 300 份额的份额净值在某一开放日大于或等于 2.000 元，则进行不定期份额折算。基金管理人将就不定期份额折算的折算日的确定及相关事项予以公告。

(4) 本基金运作期间，如久兆积极份额的份额参考净值在某一开放日小于或等于 0.250 元，则进行不定期份额折算。基金管理人将就不定期份额折算的折算日的确定及相关事项予以公告。

(5) 本基金不定期份额折算结束后，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。

## 十九、久兆稳健份额与久兆积极份额的终止运作

(一) 经基金份额持有人大会决议通过，久兆稳健份额与久兆积极份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的久兆 300 份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

(二) 久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作后的份额转换

久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，久兆稳健份额、久兆积极份额将全部转换成久兆 300 份额的场内份额。

#### 1. 份额转换基准日

久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作日(如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日)。

#### 2. 份额转换方式

在转换基准日日终，以久兆 300 份额的基金份额净值为基准，久兆稳健份额、久兆积极份额按照各自的基金份额参考净值转换成久兆 300 份额的场内份额。久兆稳健份额（或久兆积极份额）基金份额持有

人持有的转换后久兆 300 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

$$\text{久兆稳健份额持有人持有的转换后场内久兆 300 份额的份额数} = \frac{NAV^{\text{稳健}} \times NUM^{\text{稳健}}}{NAV^{300}}$$

$$\text{久兆积极份额持有人持有的转换后场内久兆 300 份额的份额数} = \frac{NAV^{\text{积极}} \times NUM^{\text{积极}}}{NAV^{300}}$$

其中， $NAV^{\text{稳健}}$  表示份额转换前久兆稳健份额的份额参考净值； $NAV^{\text{积极}}$  表示份额转换前久兆积极份额的份额参考净值； $NAV^{300}$  表示久兆 300 份额的份额净值； $NUM^{\text{稳健}}$  表示份额转换前久兆稳健份额的份额数； $NUM^{\text{积极}}$  表示份额转换前久兆积极份额的份额数。

### 3. 份额转换后的基金运作

久兆稳健份额与久兆积极份额全部转换为久兆 300 份额的场内份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回。

### 4. 份额转换的公告

久兆稳健份额与久兆积极份额进行份额转换结束后，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 二十、基金的会计与审计

### (一) 基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### (二) 基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 二十一、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基

金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1. 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
2. 对证券投资业绩进行预测；
3. 违规承诺收益或者承担损失；
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
6. 中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

#### (一) 招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

#### (二) 基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

#### (三) 基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

#### (四) 基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

#### (五) 基金份额上市交易公告书

久兆稳健份额和久兆积极份额获准在证券交易所上市交易，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

#### (六) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值；

2. 在久兆稳健份额、久兆积极份额上市交易或开始办理久兆 300 份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日久兆 300 份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计净值；

3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和久兆 300 份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值以及久兆 300 份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

#### （七）久兆 300 份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明久兆 300 份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （七）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1. 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2. 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3. 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4. 基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5. 基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### （八）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

1. 基金份额持有人大会的召开及决议；
2. 终止基金合同；
3. 转换基金运作方式；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
7. 基金募集期延长；
8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
10. 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
12. 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
13. 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；



14. 重大关联交易事项；
15. 基金收益分配事项；
16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
17. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
18. 基金改聘会计师事务所；
19. 基金变更、增加或减少代销机构；
20. 基金更换注册登记机构；
21. 久兆 300 份额开始办理申购、赎回；
22. 久兆 300 份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 本基金暂停接受久兆 300 份额申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；
27. 本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
28. 本基金实施基金份额折算；
29. 久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作；
30. 久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作后久兆稳健份额、久兆积极份额的份额转换；
31. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### (九) 澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### (十) 基金份额持有人大会决议

#### (十一) 中国证监会规定的其他信息

#### (十二) 信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件或复印件。

基金定期报告公布后，应当置备于基金管理人的住所，以及久兆稳健份额与久兆积极份额上市交易的证券交易所，以供公众查阅、复制。本基金的上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人和久兆稳健份额与久兆积极份额上市交易的证券交易所，以供公众查阅、复制。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 二十二、风险揭示

本基金为指数型证券投资基金，主要投资于股票资产。本基金面临的投资风险主要包括以下几方面：

### (一) 市场风险

广义的市场风险指与利率、股票价格、商品价格等相关的风险，主要与不同市场的供需情况紧密联系。狭义的市场风险主要指股票价格波动风险。

### (二) 流动性风险

流动性风险指金融资产变现的难易程度。一些情况下，市场无法有效执行交易头寸需要，将使得金融资产无法在价格平稳变动的基础上被购入或者卖出。本基金面临的流动性风险来自两个方面：

1、大额赎回：本基金属于开放式指数型基金，在交易过程中，有发生集中大额赎回的可能性。集中大额赎回可能导致基金资产变现难度加剧，从而产生流动性风险；甚至可能由于大额出售个券引致个券价格出现大幅波动，从而对基金资产净值产生影响。

2、特殊的市场情形：在特殊市场情形下，如市场资金紧张时，市场整体流动性降低，将可能导致个券的变现能力减弱，从而产生流动性风险。

### (三) 信用风险

信用风险指由于交易对手或债务人无法按照约定交割资产而导致基金资产损失的风险，主要指违约风险。本基金的信用风险分析主要针对债券资产，具体包括以下几个方面：

- 1、债券发行人出现违约，无法支付到期本息引起的损失。
- 2、债券发行人信用评级下降导致的个券价格下跌损失。
- 3、交易对手出现违约或违规投资操作而引起的损失。

### (四) 操作风险

操作风险指由于我司信息系统、投资运作系统或其他外部事件导致的操作失灵或失误带来基金资产损失的风险。这一风险主要来自于计算机系统失灵（如病毒、软件错误）、人为失误和公司以外的不可控因素。

### (五) 模型风险

模型风险指投资估值模型的参数错误或模型运用不当带来的基金资产损失风险。在利用定价模型对金融资产，尤其是金融衍生产品进行定价的过程中，容易出现模型风险。

### (六) 法律/合同风险

法律/合同风险指合同签约的一方无法履行合同规定的义务，造成另外一方损失时可能发生的法律诉讼风险。

### (七) 通货膨胀风险

通货膨胀风险指物价水平上市导致本基金的名义收益率在剔除通货膨胀因素影响后降低的风险。

### (八) 不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力的出现将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；金融市场危机、行业竞争、托管行违约等超出基金管理人自身控制能力之外的风险，也可能导致基金或基金持有人的利益受损。

### (九) 本基金的特有风险

#### 1、被动跟踪指数的风险

主要表现在以下几方面：

(1) 指数下跌风险：即在市场下跌的情况下由于本基金跟踪指数下跌而对基金净值造成损失的不确定性。

(2) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险：标的指数代表的是A股某个细分子市场股票的整体表现，其回报率与股票市场的平均回报率之间可能存在偏离。

(3) 目标指数的风险：即目标指数因为编制方法的缺陷有可能导致目标指数的表现与市场表现的差异，增加基金投资成本，并有可能因此而增大跟踪误差，影响投资收益。

(4) 跟踪偏离风险：即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与业绩比较

基准表现之间产生差异的不确定性，可能的原因包括：

①基金在跟踪指数过程中由于买入和卖出证券时均存在交易成本例如印花税、交易佣金、过户费等交易成本，导致本基金在跟踪指数时可能产生收益上的偏离。

②基金管理过程中受现金拖累而对跟踪指数表现造成影响。产生现金拖累的主要原因包括基金合同要求必须留存的现金比例、成份股现金分红、基金每日申购赎回。本基金在实际管理过程中由于成份股现金分红或投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标指数的成份股票，或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将股票及时地转化为现金，这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险。

③在本基金实行指数化投资过程中，管理人对指数基金的管理能力，如跟踪指数的技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对目标指数的跟踪程度。

④标的指数调整成份股构成或成份股公司发生送股、增发等行为可能导致该成份股在指数中的权重发生变化；标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时无法跟踪标的指数的成份股构成，从而导致跟踪误差的加大。

⑤当标的指数成份股遭遇投资限制或流动性较差，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将采用其他合理方法进行适当的替代，替代股票与被替代股票表现之间的差异可能导致跟踪偏离。

⑥其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能发生偏离；因指数发布机构指数编制错误等原因产生的跟踪偏离和跟踪误差等情形。

## 2、场内交易份额的特有风险

### (1) 流动性风险

本基金的久兆稳健份额和久兆积极份额在深圳证券交易所挂牌上市，上市交易份额可能存在因交易对手不足导致的流动性风险。

### (2) 杠杆风险

本基金场内基础份额久兆 300 份额可以分离成一定比例的久兆稳健份额和久兆积极份额，久兆稳健份额具有低风险、预期低收益的特征，久兆积极份额具有高风险、预期高收益的特征。由于久兆积极份额在设计上含有杠杆机制，预期其波动程度将大于久兆 300 基础份额和久兆稳健份额。

### (3) 折/溢价交易风险

久兆稳健份额和久兆积极份额上市交易后，其价格可能与参考净值之间出现差异，进而产生折价或溢价风险。

### (4) 区间约定收益率及投资实现风险

久兆稳健份额作为低风险，预期收益率较低的份额，理论上可以获得久兆积极份额支付的约定收益。然而在运作期内，本基金不进行收益分配，而是在每个定期份额折算日将久兆稳健份额参考净值超过 1.000 元的部分折算成场内久兆 300 份额的形式进行约定收益分配。由于股票市场价格的变化，以场内久兆 300 份额的形式进行的约定收益分配存在波动的可能，进而存在无法足额变现期间约定收益的风险。

### (5) 风险收益特征变化风险

由于本基金不定期份额折算运制的存在，在不定期份额折算操作后，原场内交易份额持有人所持有的部分份额的风险收益特征可能发生改变。

## 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 终止久兆稳健份额与久兆积极份额的运作；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更久兆300份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

### (二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4. 中国证监会规定的其他情况。

### (三) 基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

## 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

## 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

## 4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；

(4) 根据基金合同终止日久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额各自参考净值分别计算久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

## 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十四、基金合同的内容摘要

(一) 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

### 1. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

(1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

(2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 发售基金份额；

(4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

(6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理久兆 300 份额申购申请、暂停受理久兆 300 份额赎回申请；

(8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

(9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(10) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(13) 依法召集基金份额持有人大会；

(14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 2. 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

(1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的

发售、申购、赎回和登记事宜；

- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 计算并公告基金资产净值、久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值和久兆300份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理久兆300份额申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制中期和年度基金报告；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- (16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金

托管人：

- (24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### 3. 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

- (1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (6) 依法召集基金份额持有人大会；
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；
- (8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 4. 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；



- (10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值和久兆300份额申购、赎回价格；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (19) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### 5. 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让其持有的久兆稳健份额与久兆积极份额，依法申请赎回其持有的久兆300份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

## 6. 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

### (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表在授权范围内有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。基金份额持有人大会的审议事项应分别由久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

#### 2. 召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人、单独或合计持有久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上(含10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 终止久兆稳健份额与久兆积极份额的运作；
- 10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更久兆300份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3. 召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 单独或合计代表久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

(4) 单独或合计代表久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

### 4. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式;
- 2) 会议拟审议的主要事项;
- 3) 会议形式;
- 4) 议事程序;
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;
- 6) 代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
- 7) 表决方式;
- 8) 会务常设联系人姓名、电话;
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

## 5. 基金份额持有人出席会议的方式

### (1) 会议方式

- 1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
- 2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。
- 3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。
- 4) 会议的召开方式由召集人确定。

### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

#### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时,现场会议方可举行:

①对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,全部有效凭证所对应的久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额应占权益登记日各自基金份额的50%以上(含50%,下同);

②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备,到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基

金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金注册登记机构持有的注册登记资料相符。

## 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

①召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

②召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

③召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

④本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日各自基金份额的50%以上；

⑤直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

## 6. 议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权益登记日久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的

除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后, 如果需要对原有提案进行修改, 应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的, 其授权代表未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权代表主持; 如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会, 则由出席大会的久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下, 首先由召集人提前30日公布提案, 在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额表决权的50%以上通过方为有效, 除下列2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

### 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效; 涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、

终止久兆稳健份额与久兆积极份额的运作、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

(4) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 8. 计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9. 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第2条所规定的第1)– 9)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第2条所规定的第10)、11)项召开事

由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

10. 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### (三) 基金合同解除和终止的事由、程序

#### 1. 基金合同的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

1) 转换基金运作方式；

2) 变更基金类别；

3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

4) 变更基金份额持有人大会程序；

5) 更换基金管理人、基金托管人；

6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

7) 本基金与其他基金的合并；

8) 终止久兆稳健份额与久兆积极份额的运作；

9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更久兆300份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率；

3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

#### 2. 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；



(2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

(3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

(4) 中国证监会规定的其他情况。

### 3. 基金财产的清算

#### (1) 基金财产清算组

1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### (2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

#### (4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 根据基金合同终止日久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额各

自参考净值分别计算久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款1)–3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### (5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### (6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### (四) 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

#### (五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1. 本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

2. 本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

3. 本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金

管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

4. 本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十五、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1. 基金管理人

名称：长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

邮政编码：518026

法定代表人：杨光裕

成立日期：2001年12月27日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务

#### 2. 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：张建国（代行）

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中小板300（价格）指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、资产支持证券、权证，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于90%，其中将不低于90%的股票资产投资于中小板300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，进行组合资产管理。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

(1) 本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于90%，其中将不低于90%的股票资产投资于中小板300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

(2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%。

(3) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券不得超过基金资产净值的10%；本基金持有的全部资产支持证券市值不得超过基金资产净值的20%。

(4) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(5) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的5%。

(6) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日

内进行调整。

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基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

(1) 本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

(2) 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

(3) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

(4) 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定

媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

(5) 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

- 1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。
- 2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。
- 3) 有关比例限制的执行情况。
- 4) 信息披露情况。

(6) 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

6. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7. 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

8. 基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9. 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

10. 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节



严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金管理人

1. 基金管理人

2. 基金管理人

3. 基金管理人

### （四）基金财产的保管

#### 1. 基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。  
(2) 基金托管人应安全保管基金财产。  
(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。  
(4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。  
(5) 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

(6) 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

(7) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### 2. 基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### 3. 基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他资金账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### 4. 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

### 5. 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6. 其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8. 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

### (五) 基金资产净值计算与复核

#### 1. 基金资产净值

本基金分别计算并公告久兆 300 份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值。

##### (1) 久兆 300 份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

久兆 300 份额的基金份额净值计算公式为：

$T$  日久兆 300 份额的基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日本基金（包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）的基金份额余额总数

##### (2) 久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值计算

1) 本基金四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额的参考净值之和将等于十份久兆 300

份额的净值。

2) 久兆稳健份额的约定收益率为 5.8%。久兆稳健份额的约定收益率除以 365 得到久兆稳健份额的约定日简单收益率。久兆稳健份额的基金份额参考净值以基金合同生效日或前一份额折算日经折算后的份额净值为基准采用久兆稳健份额的约定日简单收益率单利进行计算。久兆稳健份额在估值日应计收益的天数为自基金合同生效日或前一份额折算日（定期份额折算日或不定期份额折算日）次日起至估值日的实际天数。

3) 计算出久兆稳健份额的份额参考净值后，根据久兆稳健份额、久兆积极份额和久兆 300 份额净值的关系，计算出久兆积极份额的份额参考净值。

4) 本基金进行定期份额折算或不定期份额折算操作以后，久兆稳健份额、久兆积极份额的份额参考净值计算方法保持不变。

5) 久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值计算公式

$$NAV_T^{\text{稳健}} = 1.000 + 1.000 \times \left( \frac{5.8\%}{365} \times t \right)$$

$$NAV_T^{\text{积极}} = \left( NAV_T^{300} - 0.4 \times NAV_T^{\text{稳健}} \right) / 0.6$$

其中， $T$  表示估值日； $t$  表示久兆稳健份额在估值日应计收益的天数， $t = \min$  (基金合同生效日至估值日的实际天数，前一定定期份额折算日次日起至估值日的实际天数，前一定定期份额折算日次日起至估值日的实际天数)； $NAV_T^{\text{稳健}}$ 、 $NAV_T^{\text{积极}}$  分别表示久兆稳健份额与久兆积极份额在  $T$  日的基金份额参考净值； $NAV_T^{300}$  表示久兆 300 份额在  $T$  日的基金份额净值。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值、久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值，经基金托管人复核，按规定公告。

## 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3. 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## （六）基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、久兆稳健份额与久兆积极份额上市交易的前一日、久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作日、基金份额折算日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册由基金管理人自基金注册登记机构取得后，转交给基金托管人。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额名称与基金份额。

本基金的基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照国家目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## （七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## （八）托管协议的修改与终止

### 1. 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### 2. 基金托管协议终止出现的情形

#### （1）基金合同终止；

- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十六、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）持有人交易资料的寄送服务

1. 注册登记人保留持有人名册上列明的所有持有人的基金交易记录。
2. 每季度结束后10个工作日内，注册登记人向本季度有交易的投资者寄送对账单。
3. 每年度结束后10个工作日内，注册登记人向所有持有本基金份额的投资者或在最后一个季度内有交易的投资者寄送对账单。

（二）客户服务中心（Call Center）24 小时电话服务，提供查询、咨询、投诉受理等业务

公司网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)

客服邮箱：[support@ccfund.com.cn](mailto:support@ccfund.com.cn)

客服电话：400-8868-666

## 二十七、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。招募说明书条款及内容应以招募说明书正本为准。

投资者还可以登录基金管理人的网站 (<http://www.ccfund.com.cn>) 查阅和下载本招募说明书。



## 二十八、备查文件

- (一) 中国证监会批准长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金设立的文件
- (二) 《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

长城基金管理有限公司

二〇一一年十二月十二日