

## 关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金 办理不定期份额折算业务的公告

根据《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”）第二十一章“基金份额折算”中关于不定期份额折算的有关规定，当长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之积极份额（场内简称：中小 300B，基金代码：150058）的份额参考净值在某一开放日小于或等于 0.250 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 9 月 15 日，中小 300B 的基金份额参考净值为 0.244 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同的约定以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2015 年 9 月 16 日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

### 一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2015 年 9 月 16 日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称：长城久兆，基金代码：162010）、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之稳健份额（场内简称：中小 300A，基金代码：150057）、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之积极份额（场内简称：中小 300B，基金代码：150058）。

### 三、基金份额折算方式

当中小 300B 份额的份额参考净值达到 0.250 元时，不定期份额折算后，长城久兆份额的基金份额净值以及中小 300A 份额与中小 300B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元；持有人持有的长城久兆份额的份额数按照长城久兆份额折算比例相应减少，中小 300B 份额持有人持有的中小 300B 份额数按照中小 300B 份额的折算比例相应减少。为保持中小 300A 份额和中小 300B 份额比例不变，中小 300A 份额的折算比例与中小 300B 份额相同，中小 300A 份额持有人持有的中小 300A 份额数同比例相应减少，超出份额数将全部折算成长城久兆份额的场内份额。

不定期份额折算前后，中小 300A 份额和中小 300B 份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内长城久兆份额不进行自动分离。

#### 1、长城久兆份额

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

其中,  $NAV_{前}^{300}$  表示不定期份额折算前长城久兆份额的份额净值;  $NAV_{后}^{300}$  表示不定期份额折算后长城久兆份额的份额净值;  $NUM_{前}^{300}$  表示不定期份额折算前长城久兆份额的份额数;  $NUM_{后}^{300}$  表示不定期份额折算后长城久兆份额的份额数。

长城久兆份额不定期份额折算后, 场外长城久兆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; 场内长城久兆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、中小 300A 份额和中小 300B 份额

$$NAV_{后后}^A = NAV^B = 1.000, \quad NUM_{后后}^A = \frac{4}{6} \times NUM^B = \frac{4}{6} \times \frac{NAV_{前前}^B \times NUM^B}{1.000}$$

中小 300A 份额持有人新增的场内长城久兆份额的份额数

$$= \frac{(NAV_{前后}^A \times NUM^A - 1.000 \times NUM^A)}{1.000}$$

其中,  $NAV_{前}^A$  表示不定期份额折算前中小 300A 份额的份额参考净值;  $NAV_{前}^B$  表示不定期份额折算前中小 300B 份额的份额参考净值;  $NAV_{后}^A$  表示不定期份额折算后中小 300A 份额的份额参考净值;  $NAV_{后}^B$  表示不定期份额折算后中小 300B 份额的份额参考净值;  $NUM_{前}^A$  表示不定期份额折算前中小 300A 份额的份额数;  $NUM_{前}^B$  表示不定期份额折算前中小 300B 份额的份额数;  $NUM_{后}^A$  表示不定期份额折算后中小 300A 份额的份额数;  $NUM_{后}^B$  表示不定期份额折算后中小 300B 份额的份额数。

中小 300A 份额不定期份额折算后, 因折算新增的场内长城久兆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。

## 四、不定期份额折算示例

假设某投资人持有场外长城久兆份额、场内长城久兆份额、中小 300A 份额和中小 300B 份额分别为 10,000 份、2,000 份、4,000 份和 6,000 份。在本基金的不定期份额折算基准日, 假设基金份额 (参考) 净值如下表所示 (为便于投资者理解, 此处采用假设的净值进行计算; 基准日折算前准确的净值以当日日终基金管理人计算并经托管人复核的净值

为准)，折算后，长城久兆份额、中小 300A 份额和中小 300B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

	折算前		折算后	
	基金份额(参考)净值 (假设值)	基金份额	基金份额 (参考)净值	基金份额
场外长城久兆份额	0.550	10,000.00	1.000	5,500 份场外长城久兆份额
场内长城久兆份额	0.550	2,000	1.000	1,100 份场内长城久兆份额
中小 300A 份额	1.016	4,000	1.000	956 份中小 300A 份额及新增的 3,108 份场内长城久兆份额
中小 300B 份额	0.239	6,000	1.000	1,434 份中小 300B 份额

#### 五、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日（即 2015 年 9 月 16 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、份额配对转换业务；中小 300A 份额和中小 300B 份额将于当日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于上午 10:30 复牌；折算基准日日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 9 月 17 日），本基金将暂停办理申购、赎回、转托管、份额配对转换业务；中小 300A 份额和中小 300B 份额于该日暂停交易；本基金注册登记机构及基金管理人将为持有人办理份额登记确认。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 9 月 18 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额；中小 300A 份额和中小 300B 份额将于该日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于上午 10:30 之后复牌；自该日起，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、份额配对转换业务。

4、根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2015 年 9 月 18 日中小 300A 份额和中小 300B 份额即时行情显示的前收盘价为 2015 年 9 月 17 日的中小 300A 份额和中小 300B 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。

5、2015 年 9 月 18 日中小 300A 份额和中小 300B 份额均可能出现交易价格大幅波动的情形，敬请投资者注意投资风险。

#### 五、重要提示

1、2015 年 9 月 15 日中小 300B 的份额参考净值已跌至 0.250 元以下，而折算基准日为 2015 年 9 月 16 日，因此折算基准日中小 300B 的份额参考净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。

2、特别提示：近日中小 300B 份额二级市场交易价格溢价较大，在不定期份额折算后，中小 300B 份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意中小 300B 份额高溢价交易所带来的风险。

3、中小 300B 份额表现为较高风险、较高预期收益的特征。随着中小 300B 份额的基金份额参考净值降低，其杠杆率升高。在不定期份额折算后，中小 300B 份额的杠杆率将恢复至初始杠杆水平。

4、中小 300A 表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后中小 300A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的中小 300A 变为同时持有较低风险收益特征的中小 300A 与较高风险收益特征的长城久兆份额的情况，因此中小 300A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外，长城久兆份额为跟踪中小板 300 指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原中小 300A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和基金管理人的相关业务规则，场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分舍去，舍去部分计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分计入基金财产。因此，在不定期份额折算过程中，由于尾差处理，可能使持有人的资产净值出现微小误差，但视为未改变基金份额持有人的资产净值。

6、可以在二级市场进行交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买了中小 300A 份额，在不定期份额折算后，因折算新增的长城久兆份额将无法赎回。投资者可以选择在折算前将中小 300A 份额卖出，或者在折算后将新增的长城久兆份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

本公告仅对本基金本次不定期份额折算业务进行相关说明，投资者欲了解本基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金基金合同及本基金招募说明书（更新），也可以访问本公司网站（[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)）、拨打本公司客服电话（400-8868-666）进行查询或咨询。

特此公告

长城基金管理有限公司

2015 年 9 月 16 日