

## 关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金 不定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）以 2015 年 9 月 16 日为基准日，对长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）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 指数证券投资基金之积极份额（场内简称：中小 300B，基金代码：150058）实施了不定期份额折算，现将有关事项公告如下：

### 一、 份额折算结果

2015 年 9 月 16 日，长城久兆份额的场外份额经折算后的份额数按四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；长城久兆份额的场内份额、中小 300A 份额和中小 300B 份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。基金份额折算比例按截位法精确到小数点后第 9 位，折算结果如下表所示：

基金份额名称	折算前基金份额 (单位：份)	折算前基金份 额净值 (单位：元)	折算比例	折算后基金份额 (单位：份)	折算后基金 份额净值 (单位：元)
长城久兆场外份额	34,078,209.25	0.593	0.593369819	20,221,001.11	1.000
长城久兆场内份额	2,658,457.00	0.593	0.593369819	17,407,473.00 (注 1)	1.000
中小 300A 份额	22,328,261.00	1.019	0.309782580	6,916,906.00	1.000
			0.708968118	15,830,025.00 (注 2)	
中小 300B 份额	33,492,392.00	0.310	0.309782580	10,375,359.00	1.000

注 1：该“折算后基金份额”包括中小 300A 份额经折算后产生的新增场内长城久兆份额。

注 2：该“折算后基金份额”为中小 300A 份额经折算后产生的新增场内长城久兆份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记机构确认的折算后份额。

### 二、 恢复交易

自 2015 年 9 月 18 日起，本基金恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管）和份额配对转换业务，中小 300A 份额（基金代码：

150057) 和中小 300B 份额 (基金代码: 150058) 将于 2015 年 9 月 18 日上午 9:30-10:30 停牌一小时后复牌。

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 份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2015 年 9 月 17 日中小 300A 和中小 300B 的基金份额参考净值，分别为 1.000 元和 0.972 元。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。

### 三、 重要提示

1、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。

2、中小 300A 份额表现为低风险、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。

3、由于中小 300A 份额和中小 300B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，中小 300A 份额和中小 300B 份额的折溢价率可能发生较大变化，提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价变化带来的风险。

4、此次通过折算新增的场内长城久兆份额可通过办理份额配对转换业务分拆为中小 300A 份额和中小 300B 份额。

5、本次不定期份额折算后，长城久兆份额的份额数量会增加。根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量中小 300A 份额、中小 300B 份额和场内长城久兆份额的持有人，存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

特此公告

长城基金管理有限公司

2015 年 9 月 18 日