

## 长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金定期份额折算公告

根据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》（简称“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，长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在 2016 年 1 月 29 日办理定期份额折算业务。现将相关事项公告如下：

### 一、基金份额折算日

根据基金合同的规定，本基金定期份额折算日为每个基金运作周年的最后一个工作日。本基金成立于 2012 年 1 月 30 日，第四个运作周年的最后一个工作日为 2016 年 1 月 29 日，即本次定期份额折算日为 2016 年 1 月 29 日。

### 二、基金份额折算对象

定期份额折算的折算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（简称“长城久兆”，交易代码：162010）和长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之稳健份额（简称“中小 300A”，交易代码：150057）。

### 三、基金份额折算方式

本基金进行定期份额折算后，中小 300A 份额期末的约定应得收益将折算为场内长城久兆份额分配给中小 300A 份额持有人，中小 300A 份额的份额参考净值调整为 1.000 元；长城久兆份额持有人持有的每十份长城久兆份额将按四份中小 300A 份额获得新增长城久兆份额的分配，持有场外长城久兆份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外长城久兆份额的分配，持有场内长城久兆份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内长城久兆份额的分配。

经过定期份额折算，长城久兆份额的份额净值相应进行调整。定期份额折算前后，中小 300B 份额的份额参考净值及其份额数未发生变化，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。

#### （一）长城久兆份额

$$NAV_{后}^{300} = NAV_{前前}^{300} - 0.4 \times (NAV^A - 1.000)$$

$$\text{长城久兆份额持有人新增的长城久兆份额数} = \frac{0.4 \times (NAV_{前前}^A - 1.000) \times NUM^{300}}{NAV_{后}^{300}}$$

$$NUM_{后}^{300} = NUM_{前}^{300} + \text{长城久兆份额持有人新增的长城久兆份额数}$$

$$= NUM_{前}^{300} + \frac{0.4 \times (NAV_{前前}^A - 1.000) \times NUM^{300}}{NAV_{后}^{300}}$$

其中， $NAV_{前}^{300}$  表示定期份额折算前长城久兆份额的份额净值； $NAV_{后}^{300}$  表示定期份额折算后长城久兆份额的份额净值； $NAV_{前}^A$  表示定期份额折算前中小 300A 份额的份额参考净值； $NUM_{前}^{300}$  表示定期份额折算前长城久兆份额持有人持有的长城久兆份额数； $NUM_{后}^{300}$  表示定期份额折算后长城久兆份额持有人持有的长城久兆份额数。

长城久兆份额定期份额折算后，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。

#### （二）中小 300A 份额

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

中小 300A 份额持有人新增的场内长城久兆份额的份额数 =  $\frac{\text{期末的约定应得收益}}{NAV_{后}^{300}}$

$$= \frac{(NAV_{前前}^A - NAV_{后}^A) \times NUM^A}{NAV_{后}^{300}}$$

其中， $NAV_{前}^A$  表示定期份额折算前中小 300A 份额的份额参考净值； $NAV_{后}^A$  表示定期份额折算后中小 300A 份额的份额参考净值； $NAV_{后}^{300}$  表示定期份额折算后长城久兆份额的份额净值； $NUM_{前}^A$  表示定期份额折算前中小 300A 份额持有人持有的中小 300A 份额数； $NUM_{后}^A$  表示定期份额折算后中小 300A 份额持有人持有的中小 300A 份额数。

中小 300A 份额定期份额折算后，中小 300A 份额持有人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。

#### （三）中小 300B 份额

定期份额折算不改变中小 300B 份额的份额参考净值及其份额数，中小 300A 份额和中小 300B 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。

#### （四）举例

假设 2016 年 1 月 29 日为本基金定期份额折算日，当日折算前长城久兆、中小 300A、

中小 300B 的基金份额净值分别为 1.181 元、1.058 元、1.263 元，投资者 A、B、C、D 分别持有 10000 份长城久兆场外、长城久兆场内、中小 300A、中小 300B 的份额，则：

基金份额折算日折算后，

长城久兆的基金份额净值 =  $1.181000000 - 0.4 \times (1.058000000 - 1.000) = 1.158$  元

中小 300A 的基金份额净值 = 1.000 元

中小 300B 的基金份额净值 = 1.263 元

投资者 A 新增的长城久兆份额数 =  $[0.4 \times (1.058000000 - 1.000) \times 10000] / 1.158 = 200.35$  份（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）

投资者 B 新增的长城久兆份额数 =  $[0.4 \times (1.058000000 - 1.000) \times 10000] / 1.158 = 200$  份（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）

投资者 C 新增的长城久兆份额数 =  $[(1.058000000 - 1.000) \times 10000] / 1.158 = 500$  份（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）

即基金份额折算日折算后，投资者 A 将持有长城久兆场外份额 10200.35 份、投资者 B 将持有长城久兆场内份额 10200 份、投资者 C 将持有中小 300A 份额 10000 份及长城久兆场内份额 500 份、投资者 D 仍持有中小 300B 份额 10000 份。

#### 四、基金份额折算期间的业务办理

（一）基金份额折算日（即 2016 年 1 月 29 日），本基金暂停办理申购（包括定期定额投资，下同）、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；中小 300A、中小 300B 正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

（二）基金份额折算日后的第一个工作日（即 2016 年 2 月 1 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，中小 300A 暂停交易、中小 300B 正常交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）基金份额折算日后的第二个工作日（即 2016 年 2 月 2 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，中小 300A 于当日上午 10:30 恢复交易、中小 300B 正常交易。

（四）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》，2016 年 2 月 2 日中小 300A 即时行情显示的前收盘价为 2016 年 2 月 1 日的中小 300A 份额净值（四舍五

入至 0.001 元)。由于中小 300A 折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除第四个运作周年的约定收益后与 2016 年 2 月 2 日的前收盘价可能有较大差异，2016 年 2 月 2 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

## 五、重要提示

1、由于中小 300A 新增份额折算成长城久兆的场内份额数和长城久兆的场内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，持有较少中小 300A 或长城久兆的份额持有人存在无法获得新增场内长城久兆份额的可能性。因此，上述份额持有人可在基金份额折算日之前将原有份额卖出（或赎回）或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

2、本基金原中小 300A 份额持有人在定期份额折算后将持有中小 300A 份额和本基金基础份额——长城久兆份额，因此，持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的较低风险收益特征份额变为同时持有较低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。

投资者若希望了解基金份额折算业务详情，请登录本公司网站：

[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn) 或者拨打本公司客服电话：400-8868-666（免长途话费）。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告

长城基金管理有限公司

2016 年 1 月 26 日