

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金第一个分级运作期到期及转入下一分级运作的 相关规则公告

长城基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下基金长城久盈纯债分级债券型证券投资基金（基金代码：000768，以下简称“本基金”；长城久盈纯债分级债券型证券投资基金之久盈 A 份额，基金代码：000769，以下简称“久盈 A”；长城久盈纯债分级债券型证券投资基金之久盈 B 份额，基金代码：000770，以下简称“久盈 B”）的基金合同于 2014 年 10 月 28 日生效。根据《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的相关规定，本基金的每个分级运作期为 2 年，第一个分级运作期为自基金合同生效之日起至 2 年后对应日止，如该对应日为非工作日，则分级运作期到期日为该日前的最后一个工作日。即本基金第一个分级运作期自 2014 年 10 月 28 日起至 2016 年 10 月 28 日止。

根据基金合同约定，每个分级运作期结束后，本基金将安排不超过 10 个工作日的过渡期，过渡期结束后第一个工作日起（包括该日），本基金进入下一分级运作期。现将本基金第一个分级运作期到期及过渡期的操作规则说明如下：

一、本基金第一个分级运作期到期操作规则

（一）本基金第一个分级运作期到期日为 2016 年 10 月 28 日。在分级运作期内，久盈 A 在每个分级运作期起始日起每满 6 个月开放一次，开放期为每个分级运作期起始日起每满 6 个月的对应日（如该对应日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）及其前一个工作日，其中第一个工作日为赎回开放日，第二个工作日为申购开放日，但第 4 个开放期开放一天，只接受赎回，不接受申购，赎回开放日为分级运作期到期日前一个工作日。即 2016 年 10 月 27 日为久盈 A 第 4 个开放日，当日仅开放久盈 A 的赎回。久盈 A 的赎回不收取赎回费用。

（二）在分级运作期内，久盈 A 每满 6 个月折算一次，久盈 A 的前 3 个基金份额折算日与申购开放日为同个工作日，第 4 个基金份额折算日为分级运作期到期日；久盈 B 的基金份额折算日为分级运作期到期日。即久盈 A、久盈 B 将于 2016 年 10 月 28 日进行份额折算。久盈 A、久盈 B 的折算方案详见本基金管理人发布的《折算方案公告》。

二、本基金第一个过渡期操作规则

本基金本次过渡期的时间为 2016 年 10 月 29 日至 2016 年 11 月 11 日。

（一）过渡期内久盈 A、久盈 B 的份额配比

在过渡期内，基金管理人有权根据基金份额上限和两类份额配比进行规模控制，过渡期内久盈 A、久盈 B 的份额配比不超过 7:3。

（二）过渡期的时间安排

本基金的过渡期为每个分级运作期到期日次日起（含该日）至下一分级运作期起始日前一工作日的期间，最长不超过 10 个工作日，过渡期包括份额折算确认日、久盈 B 的开放期和久盈 A 的申购期三个阶段。

过渡期的第一个工作日为份额折算确认日，本次份额折算确认日为 2016 年 10 月 31 日，当日不接受申购与赎回。

自过渡期的第二个工作日起本基金进入久盈 B 的开放期，本次过渡期安排 2016 年 11 月 1 日至 2016 年 11 月 4 日为久盈 B 的开放期，在此期间仅开放久盈 B 的申购、赎回。

久盈 B 的开放期结束后，基金管理人将以久盈 B 的开放期结束后的久盈 B 份额余额为基准，决定是否开放久盈 A 的申购。如果在久盈 A 申购期开始前，久盈 A 的份额余额小于 7/3 倍的久盈 B 开放期末的份额余额，则开放久盈 A 的过渡期申购，久盈 A 的申购期为 2016 年 11 月 7 日至 2016 年 11 月 11 日；如果在久盈 A 申购期开始前，久盈 A 的份额余额已经大于或等于 7/3 倍的久盈 B 开放期末的份额余额，则不开放久盈 A 的过渡期申购，并按久盈 A 和久盈 B 两级份额配比不超过 7:3 的原则，采取包括但不限于比例确认、不进行或提前

终止某一类份额的过渡期申购、减少某一类份额持有人所持份额等措施对本基金进行规模控制。

本基金管理人可根据久盈 B 和久盈 A 的申购、赎回情况，调整久盈 B 和久盈 A 的开放时间，届时本基金管理人将另行公告。

过渡期结束后第一个工作日起（包括该日），本基金进入下一分级运作期。本基金过渡期内不开放久盈 A 的赎回。

（三）过渡期基金份额的申购与赎回原则及数量限制

1、基金份额赎回、申购均采用“未知价”原则，即赎回、申购价格以申请当日收市后计算的对应基金份额净值为基准进行计算；

2、基金份额根据“金额申购、份额赎回”的原则，申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额的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，在当日的开放时间结束后不得撤销。基金管理人、基金注册登记机构或证券交易所另有规定的，从其规定；

4、久盈 A 首次申购和追加申购的最低金额为 10 元；久盈 B 首次申购的最低金额为 50000 元，追加申购的最低金额为 10 元。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

5、基金份额持有人可将其全部或部分久盈 A 份额或久盈 B 份额赎回，每笔赎回申请不得低于 100 份，全额赎回时不受该限制。投资者每个交易账户不设最低基金份额余额限制。

（四）过渡期申购的销售对象

符合法律法规规定的个人投资者、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。

（五）过渡期申购与赎回的费用

1、在过渡期久盈 B 的开放期内进行久盈 B 的申购，申购费率随申购金额的增加而递减，投资人可以多次申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销柜台申购久盈 B 的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。久盈 B 的申购费率如下：

（1）申购费率

申购金额（含申购费） 申购费率

100 万元以下 0.6%

100 万元(含)-300 万元 0.4%

300 万元(含)-500 万元 0.2%

500 万元以上(含) 每笔 1000 元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。

（2）特定申购费率

申购金额（含申购费） 申购费率

100 万元以下 0.12%

100 万元(含)-300 万元 0.08%

300 万元(含)-500 万元 0.04%

500 万元以上(含) 每笔 1000 元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老产品。

如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

久盈 B 的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、在过渡期久盈 B 的开放期内进行久盈 B 的赎回，不收取赎回费用。

3、在过渡期久盈 A 的申购期内进行久盈 A 的申购，不收取申购费用。

（六）过渡期内申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

在过渡期内，基金投资者必须在久盈 B 的开放期的业务办理时间提出申购和赎回申请，必须在久盈 A 的申购期的业务办理时间提出申购申请。

投资者在申购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，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的成交确认原则

过渡期的久盈 B 的开放期内，在每一个开放日，对于久盈 B 赎回申请，上一工作日所有经确认有效的赎回申请全部予以成交确认。

过渡期的久盈 B 的开放期内，在每一个开放日，对于久盈 B 申购申请，如果对久盈 B 的全部有效申购申请进行确认后，久盈 B 的份额余额大于久盈 B 的份额上限，则在经确认后的久盈 B 份额余额不超过其份额上限的范围内，对上一工作日全部有效申购申请按比例进行成交确认；如果对久盈 B 的全部有效申购申请进行确认后，久盈 B 的份额余额小于或等于其份额上限，则对全部有效申购申请全部予以成交确认。

过渡期久盈 A 申购期内，对于久盈 A 申购申请，本基金以久盈 B 的份额余额为基准，在不超过久盈 B 的份额余额范围的 7/3 倍内对久盈 A 的申购进行份额限制。在久盈 A 申购期的每一个开放日，如果对久盈 A 的全部有效申购申请进行确认后，久盈 A 的份额余额大于 7/3 倍的久盈 B 的份额余额，则按久盈 A 和久盈 B 两级份额配比不超过 7:3 的原则，对当日久盈 A 的全部有效申购申请按比例进行成交确认，并提前结束久盈 A 份额的过渡期申购；如果对久盈 A 的全部有效申购申请进行确认后，久盈 A 的份额余额小于或等于 7/3 倍的久盈 B 的份额余额，则对当日久盈 A 的申购申请全部予以成交确认。

基金销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购和赎回申请。申购和赎回申请的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。

（七）过渡期内申购份额与赎回金额的计算

1、久盈 A 和久盈 B 的申购份额的计算

久盈 A 申购份额的计算公式为：

申购份额 = 申购金额 / 申购当日久盈 A 的基金份额净值

久盈 A 申购份额的计算，采取四舍五入的方式保留到小数点后第 2 位，由此产生的误差计入基金财产。

久盈 B 申购份额的计算公式为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)，对于 500 万元（含）以上的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份数 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

久盈 B 申购份额的计算，采取四舍五入的方式保留到小数点后第 2 位，由此产生的误差计入基金财产。

2、久盈 B 赎回金额的计算

久盈 B 赎回金额的计算公式为：

赎回金额 = 赎回份额 × 赎回当日久盈 B 份额的基金份额净值

赎回金额计算结果采取四舍五入的方式保留至小数点后第 2 位，由此产生的误差计入基金财产。

3、过渡期内本基金基金份额净值的计算

过渡期内久盈 A、久盈 B 按照各自对应的基金资产净值计算各自的基金份额净值，公式如下：

T 日久盈 A 的基金份额净值=T 日长城久盈纯债分级债券型基金资产净值/T 日长城久盈纯债分级债券型基金份额数

T 日久盈 B 的基金份额净值=T 日长城久盈纯债分级债券型基金资产净值/T 日长城久盈纯债分级债券型基金份额数

其中，T 日长城久盈纯债分级债券型基金份额数为 T 日久盈 A 份额数、T 日久盈 B 份额数之和。

基金份额净值计算结果采取四舍五入的方式保留至小数点后第 3 位，由此产生的误差计入基金财产。

（八）过渡期的基金运作安排

- 1、过渡期内，本基金基金资产保持为现金形式（不能变现的资产除外）；
- 2、过渡期内，基金管理人停收管理费，基金托管人停收托管费，销售机构停收销售服务费；
- 3、过渡期结束后的下一工作日为久盈 A 约定年化收益率起算日，即下一个分级运作期起始日；
- 4、下一个分级运作期在第一个半年内久盈 A 的份额净值、份额参考净值为在该分级运作期起始日前一日久盈 A 份额净值的基础上按照年化单利增长计算而得的份额净值、份额参考净值。

三、重要提示

（一）久盈 A 的约定年收益率

在每个分级运作期内，久盈 A 根据基金合同的规定获取约定收益，其收益率将在每个分级运作期起始日及每个申购开放日（最后一个申购开放日除外）设定一次并公告。计算公式为：

久盈 A 的年收益率（单利）=1 年期银行定期存款利率（税后）+利差。

久盈 A 的年收益率采用四舍五入法保留到以百分比表示的小数点后第 2 位。

利差的取值范围从 0（含）到 3%（含），由本基金管理人在过渡期前根据国内利率市场情况确定并提前公告。

本次久盈 A 的约定年收益率将根据第二个运作周期起始日中国人民银行公布并执行的、该日适用的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率进行计算，利差的取值为 1.8%，该收益率即为久盈 A 自第二个运作周期起始日起 6 个月的约定年收益率，即：久盈 A 第二个运作周期起始日起 6 个月的约定年收益率（单利）=1 年期银行定期存款利率（税后）+1.8%。

（二）过渡期结束后第一个工作日（2016 年 11 月 14 日）起，本基金进入下一分级运作期。本基金管理人可根据久盈 B 和久盈 A 的申购、赎回情况，调整久盈 B 和久盈 A 的开放时间，若发生调整本基金管理人将另行公告。

四、本基金的销售机构

（一）直销机构

1、长城基金管理有限公司直销中心

地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40 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网上直销交易平台

个人投资者可以通过本基金管理人网上直销交易平台办理开户和本基金的申购、赎回等业务，具体交易细则请参阅本基金管理人网站相关信息。

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

（二）代销机构

本基金的代销机构详见本基金更新的招募说明书及增加销售机构的相关公告。久盈 A 和久盈 B 的销售机构可能不同，具体销售机构和销售方式详见本基金招募说明书及相关公告。

五、其他事项

（一）本公告仅对本基金本次分级运作期到期和转入下一分级运作期的有关事项和规定予以说

明，其它未说明的事项遵循基金合同和招募说明书的规定。投资人欲了解本基金的详细情况，请登陆本基金管理人网站阅读本基金的基金合同、招募说明书及其更新。

（二）本基金管理人可综合各种情况对本基金本次分级运作期到期和转入下一分级运作期的安排做适当调整。

（三）投资人可访问本基金管理人网站(www.ccfund.com.cn)或拨打本基金管理人客户服务电话（400-8868-666）咨询相关情况。

（四）本公告解释权归本基金管理人。

特此公告

长城基金管理有限公司

2016年10月14日