关于以通讯方式召开长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况

为了更好地满足广大投资者的需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《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》”）的有关规定，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”）的基金管理人长城基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型方案等相关事宜，将本基金转型为“长城中证500指数增强型证券投资基金”，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2018年6月5日起至2018年7月4日17:00止（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）基金份额持有人或其代理人可通过专人送交或邮寄方式送达至以下地址的下述收件人。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

公证机关：深圳市深圳公证处

收件人：丁青松、卢润川

联系地址：深圳市福田区深南大道4013号兴业银行大厦17楼1706/1708

联系电话：0755-83024185/0755-83024187

邮政编码：518048

请在信封表面注明：“长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-8868-666咨询。

二、会议审议事项

《关于长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明及基金合同的详细修订内容详见《长城久兆中小板300指数分级证券

投资基金转型方案说明书》（附件四）。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年6月5日，即在2018年6月5日下午深圳证券交易所交易时间结束后，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括久兆300份额、中小300A份额与中小300B份额的基金份额持有人）或其授权的代理人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录本基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（4）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（5）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或

其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（6）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（7）以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的授权委托书等相关文件在前述会议投票表决起止时间内（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄方式送达至以下地址的下述收件人：

公证机关：深圳市深圳公证处

收件人：丁青松、卢润川

联系地址：深圳市福田区深南大道 4013 号兴业银行大厦 17 楼 1706/1708

联系电话：0755-83024185/0755-83024187

邮政编码：518048

请在信封表面注明：“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下于 2018 年 7 月 5 日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金托管人经通知但拒绝到场监督，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的每份基金份额（包括久兆 300 份额、中小 300A 份额与中小 300B 份额）在各自份额类别内享有平等表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达基金管理人委托的公证机关的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额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。

（2）如表决意见未填、多填、表决意见模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之内送达基金管理人委托的公证机关的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决票，但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；

3）送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准。

六、决议生效条件

1、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、中小 300A 份额及中小 300B 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；

2、《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》须经出席会议的久兆 300 份额、中小 300A 份额与中小 300B 份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持久兆 300 份额、中小 300A 份额与中小 300B 份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案。　基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会需要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、中小 300A 份额与中小 300B 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%以上方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，根据《基金法》，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人：长城基金管理有限公司

联系地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心40层

联系电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网址：www.ccfund.com.cn

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机关：深圳市深圳公证处

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、根据相关法律法规以及深圳证券交易所业务规则要求，本基金将自基金份额持有人大会计票之日（2018年7月5日）开市起停牌，并于基金份额持有人大会决议生效公告发布日10:30复牌（如基金份额持有人大会决议生效公告发布日为非交易日，则发布日后首个交易日开市时复牌）。

3、本次基金份额持有人大会相关公告可通过本公司网站（www.ccfund.com.cn）查阅，投资者如有任何疑问，可致电本公司客户服务电话400-8868-666咨询。

4、本公告的有关内容由长城基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型方案说明书》

长城基金管理有限公司

2018 年 6 月 1 日

附件一：

关于长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型有关事项的议案

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金份额持有人：

为了更好地满足广大投资者的需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议对长城久兆中小板300指数分级证券投资基金实施转型。长城久兆中小板300指数分级证券投资基金实施转型的具体方案详见附件四《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

为实施长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定基金转型各项工作的具体时间和方式，并根据现时有效的法律法规的要求、《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型方案说明书》和转型后开放式基金的特征，对《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上议案，请予审议。

长城基金管理有限公司

2018年6月1日

附件二：

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名或名称：

证件号码（身份证件号/营业执照号）：

基金账户号/证券账户卡号：

持有基金份额类别：　□久兆300份额　　□中小300A份额　　□中小300B份额

审议事项	同意	反对	弃权
关于长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型有关事项的议案			

基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章

2018年　　月　　日

说明：

1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”。基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见未填、多填、表决意见模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数；如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之内送达基金管理人委托的公证机关的，均为无效表决票，无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2、同一基金份额持有人拥有多个基金账户号/证券账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号/证券账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的长城久兆中小板300指数分级证券投资基金全部份额（包括久兆300份额、中小300A份额与中小300B份额）。

3、本表决票中“证件号码”，指基金份额持有人开立持有久兆300份额的基金账户或在证券交易所买卖中小300A份额、中小300B份额时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

4、本表决票可从基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书（样本）

兹全权委托　　先生 / 女士或　　机构代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2018 年 7 月 4 日的以通讯方式召开的长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

若长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金在规定时间内重新召开审议相同议案的份额持有人大会的，本授权继续有效。

持有基金份额类别：　□久兆 300 份额　　□中小 300A 份额　　□中小 300B 份额

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号或营业执照注册号）：

委托人基金账户号/证券账户卡号：

受托人（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号或营业执照注册号）：

委托日期：2018 年　　月　　日

附注：

1、以上授权是基金份额持有人就其持有的长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金全部份额（包括久兆 300 份额、中小 300A 份额与中小 300B 份额）向受托人所做授权。

2、本授权委托书中“证件号码”，指基金份额持有人开立持有久兆 300 份额的基金账户或在证券交易所买卖中小 300A 份额、中小 300B 份额时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

3、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型方案说明书

一、声明

1、为了更好地满足广大投资者的需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和《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”）等有关规定，本基金管理人（长城基金管理有限公司）经与基金托管人（中国建设银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。

2、本次长城久兆中小板300指数分级证券投资基金（以下简称“长城久兆中小板300”）转型方案须经出席会议的久兆300份额、中小300A份额与中小300B份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持久兆300份额、中小300A份额与中小300B份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的决议需依法报中国证监会备案，自表决通过之日起生效。中国证监会对本次长城久兆中小板300转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型方案概要

长城久兆中小板300转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“长城久兆中小板300指数分级证券投资基金”更名为“长城中证500指数增强型证券投资基金”（以下简称“长城中证500指数增强”或“本基金”）。

（二）取消分级运作机制

长城久兆中小板300取消分级运作机制。在基金份额持有人大会审议通过后，中小300A份额、中小300B份额、久兆300份额将根据转型方案的约定全部转换为长城中证500指数增强份额，因而也不再设置基金份额的分级、折算、配对转换等机制。

（三）终止上市交易

长城久兆中小板300目前上市交易的份额为中小300A份额以及中小300B份额，长城久兆中小板300取消分级机制后，中小300A份额以及中小300B份额全部转换为非上市的长城中证500指数增强份额，不再进行上市交易。

（四）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排不少于 20 个交易日选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、转换转出或者卖出），具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

在《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效之前，长城久兆中小板 300 的场内基金份额持有人需提交跨系统转托管或赎回申请进行份额的赎回。未提交跨系统转托管或赎回申请的场内份额持有人所持有的基金份额仍然保留在其资金账户中。

选择期期间，久兆 300 份额的申购、赎回、日常转换业务，以及中小 300A 份额与中小 300B 份额的交易、配对转换业务照常办理。基金份额持有人在长城久兆中小板 300 正式实施转型前，可选择卖出中小 300A 份额、中小 300B 份额或赎回、转换转出久兆 300 份额。对于在选择期内未作出上述选择的基金份额持有人，其持有的久兆 300 份额、中小 300A 份额或中小 300B 份额将根据规则转换成为长城中证 500 指数增强份额。

在选择期期间，由于久兆 300 份额需应对赎回、转换转出等情况，基金管理人将提请基金份额持有人大会审议在选择期内豁免长城久兆中小板 300 基金合同中约定的投资组合比例等限制，并授权基金管理人据此落实相关事项及可根据实际情况做相应调整，如可暂停长城久兆中小板 300 的申购、赎回、日常转换或调整申购、赎回、日常转换的方式及限额等。

（五）基金份额的转换业务

转型选择期届满后，基金管理人将确定份额转换起始日(假设该日为 T 日)，从 T 日起开始办理长城久兆中小板 300 的各类基金份额转换成长城中证 500 指数增强基金份额。

1、在份额转换起始日（T 日）日终，将中小 300A 份额与中小 300B 份额转换成久兆 300 份额的场内份额

在份额转换起始日（T 日）日终，以久兆 300 份额的基金份额净值为基准，中小 300A 份额、中小 300B 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。中小 300A 份额（或中小 300B 份额）基金份额持有人持有的转换后久兆 300 份额的场内份额数取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临基金资产净值减小的风险，对于持有份额数较少的中小 300A 份额、中小 300B 份额持有人，将面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金财产的风险。

份额转换计算公式如下：

中小300A（或中小300B）的转换比例＝份额转换起始日中小300A（或中小300B）的基金份额参考净值/份额转换起始日久兆300份额的基金份额净值

中小300A（或中小300B）基金份额持有人持有的转换后久兆300份额的场内份额＝基金份额持有人持有的转换前中小300A（或中小300B）的份额数×中小300A（或中小300B）的转换比例

2、在T+5日(自T日起第5个工作日，不包含T日)日终，将久兆300份额的场内份额、久兆300份额的场外份额转换成长城中证500指数增强基金份额

在中小300A份额、中小300B份额按照各自的基金份额参考净值转换成久兆300份额的场内份额后，在保持基金资产净值总额不变的前提下，T+5日日终，将久兆300份额的场内份额、久兆300份额的场外份额统一转换为份额净值为1.0000元的长城中证500指数增强份额。基金份额转换后，长城中证500指数增强的份额数保留到小数点后2位，小数点后第3位截位，由此产生的计算误差归入基金资产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临基金资产净值减小的风险。

份额转换的计算公式如下：

转换后长城中证500指数增强的份额数=久兆300份额的场内份额或久兆300份额的场外份额×T+5日久兆300份额的基金份额净值/1.0000

转换后长城中证500指数增强的份额净值为1.0000元。

（六）长城中证500指数增强型证券投资基金基金合同的生效

自长城久兆中小板300基金终止上市时，《长城中证500指数增强型证券投资基金基金合同》生效，《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》同日失效，长城久兆中小板300指数分级证券投资基金正式变更为长城中证500指数增强型证券投资基金。

长城中证500指数增强办理申购、赎回业务的时间、销售机构等具体事项将另行公告。

（七）基金份额确权登记规则

长城久兆中小板300在履行相应程序、终止上市后转型为长城中证500指数增强。原长城久兆中小板300由中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统统一变更登记至长城基金管理有限公司注册登记系统。原长城久兆中小板300份额持有人需要对其持有的基金份额进行确认与重新登记后，才能通过其办理确权业务的相关销售机构办理赎回等业务。上述过程称为“确权”。

长城久兆中小板300转型为长城中证500指数增强后，基金份额确权登记规则如下：

1、已在长城中证500指数增强的销售机构开立长城基金开放式基金账户的持有人的确权登记规则

已在长城中证500指数增强的销售机构开立长城基金开放式基金账户的持有人不需要办理其他手续，本公司自动将长城久兆中小板300转型而成的长城中证500指数增强的基金份额按照如下规则确权登记到其长城基金开放式基金账户中：

（1）有长城基金开放式基金直销账户的，优先将基金份额确权登记到持有人拥有长城基金其他基金份额的长城基金开放式基金直销账户中。如在直销机构开立的长城基金开放式基金直销账户中有数个账户拥有长城基金其他基金份额或者全部账户均没有长城基金其他基金份额，优先将基金份额确权登记到持有人最近有过交易或最近开立的长城基金开放式基金直销账户中。

（2）没有长城基金开放式基金直销账户的，基金份额将确权登记到持有人拥有长城基金其他基金份额的长城基金开放式基金代销账户中。如有数个长城基金开放式基金代销账户中拥有长城基金其他基金份额或者全部账户均没有长城基金其他基金份额，优先将基金份额确权登记到持有人最近有过交易或最近开立的长城基金开放式基金代销账户中。

2、未在长城中证500指数增强的销售机构开立长城基金开放式基金账户的持有人的确权登记规则

（1）未在长城中证500指数增强的销售机构开立长城基金开放式基金账户的持有人须到长城中证500指数增强的销售机构开立长城基金开放式基金账户，具体开户所需材料以销售机构的要求为准。

（2）销售机构在接受开户申请时将对申请人提交的申请资料的准确性、完整性及表面真实性、有效性进行核实，并将持有人的开户申请数据发送至登记机构。

（3）在收到开户申请的电子数据后，登记机构会对持有人提供的信息进行核对，核对无误后即为其确认登记为长城中证500指数增强基金份额。

3、其他情形

以下情形需要办理手工确权，持有人需将确权资料邮寄至长城基金管理有限公司审核，审核通过后方可办理确权业务：

（1）由于持有人基本信息发生变更等原因导致与长城久兆中小板300退市时中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司移交的持有人名册中信息不相符的。

（2）因继承、捐赠或其他司法原因需进行非交易过户的。

4、具体确权业务规则由基金管理人根据上述规则制定相应的细则并公告。

三、转型后“长城中证500指数增强型证券投资基金”概要

（一）基金类别

股票型证券投资基金

（二）运作方式

契约型、开放式

（三）存续期限

不定期

（四）基金的投资

1、投资目标

以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。

2、投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为： 本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%， 本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

3、投资策略

（1）资产配置策略

本基金为增强型指数基金，股票投资以中证500指数作为目标指数。除非因为分红或

基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。

（2）股票投资策略

本基金股票投资主要通过量化模型，选取预期相对基准收益较好的股票构建投资组合，在控制组合跟踪误差的基础上，力争获取超越基准的业绩回报。

本基金基于基金管理人量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子股票模型进行投资。多因子模型基于 A 股上市公司的历史数据，借助数量化的技术手段，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子，通过回测研究各个因子的历史表现，寻找收益稳定、互补性强的因子对股票进行综合评分，根据评分结果精选各个行业的优质股票构成组合。

多因子模型的因子来源主要包括基本面因子、市场交易型因子、预期性因子等。财务因子是考察根据上市公司的财务数据和市值等基本信息，包括但不限于市盈率、市净率、市销率、净利润复合增长率、营业收入复合增长率、净资产收益率、杠杆率等；市场交易型因子主要是分析二级市场行情交易中的数据，包括但不局限于换手率、波动率、贝塔、流动性指标等；预期型因子主要是根据个股的分析师评级等市场情绪和预测指标构建，是反映了机构投资者对于上市公司未来盈利状况和股价走势的一致性意见。

多因子模型在组合层面上，根据基准指数的特点严格控制行业偏离以及个股偏离，并在综合考虑预期风险和收益水平基础上进行组合权重优化，力争有效跟踪基准指数的同时获取超额收益。

（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）资产支持证券投资策略

本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

（5）中小企业私募债投资策略

与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：

①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息，分析企业的长期运作风险；②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价，评估发行人财务风险；③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率；④考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；⑤综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。

（6）股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

多头套期保值策略

本基金为指数增强基金，当指数期货大幅贴水时，可采用多头套期保值策略，即卖出部分股票持仓并买入指数期货的期货替代现货策略。持有至基差收敛，赚取期货与现货指数的价差，增强指数。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

（7）其他

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

4、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

5、风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

（五）收益分配原则

本基金的收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（六）基金的费用

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.0%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、《基金合同》生效后的指数许可使用费

本基金需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。如上述指数使用许可协议约定的指数许可使用费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。指数许可使用费自基金合同生效之日起从基金资产中计收。

指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.0112%的年费率计提。指数许可使用费每日计提，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

H＝E×0.0112%÷当年天数

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效日所在季度的指数许可使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效日所在季度的下一个季度起，指数许可使用费的收取下限为每季度 5 万元。指数许可使用费将按照上述指数使用许可协议的约定进行支付。若遇法定节假日、公休日，支付日期顺延。

4、申购费用

本基金在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，适用申购费率按每笔申购申请分别计算。

本基金对通过直销柜台申购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。具体如下：

（1）申购费率

申购金额(含申购费)	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

50 万元以下	0.24%
50 万元（含）－200 万元	0.16%
200 万元（含）－500 万元	0.08%
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，包括基本养老基金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；企业年金养老金产品。

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。

申购费用在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

5、赎回费用

本基金的赎回费率随基金份额持有时间的增加而递减，具体费率如下表所示：

持续持有期（T）	**赎回费率**
T<7 天	1.5%
7 天≤T＜365 天	0.5%
365 天≤T＜730 天	0.25%
T≥730 天	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 天的基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 天(含)但少于 92 天的基金份额所收取的赎回费的 75%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于 92 天(含)但少于 185 天的基金份额所收取的赎回费的 50%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于 185 天(含)的份额所收取的赎回费的 25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金转型前长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人的基金份额持有期限将计入其持有本基金基金份额的持有期限。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照现时有效的法律法规的规定、根据基金份额持有人大会决议修订基金合同的内容。修订后的基金合同需

经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或授权代表签章，报中国证监会备案。

四、基金管理人就转型方案相关事项的说明

（一）长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金的历史沿革

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金经 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，基金管理人为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 1 月 30 日生效。

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金将以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，若该议案获得基金份额持有人大会通过,则基金管理人将根据基金份额持有人大会的授权，对长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金实施转型，长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金将由指数分级证券投资基金转型为指数增强基金，基金名称相应变更为“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”。

（二）基金转型有利于保护份额持有人利益

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型方案是在与相关各方进行广泛沟通的基础上制定出的切实可行的方案。中证 500 指数作为 A 股市场最具代表性的指数之一，已被广大投资者熟知，因此，作为增强指数基金的标的指数更容易被投资者所接受与运用，也可以满足投资者对投资收益及交易流动性的诉求。

（三）基金转型的可行性

1、基金管理人具有丰富的基金转型运作经验，基金管理人已成功操作过基金久富转型为长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）、基金久嘉转型为长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金的封闭式基金封转开的工作，在基金转型上积累了较为丰富的经验。

2、基金转型不存在法律障碍

依据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》和《基金法》的规定，转换基金运作方式须经出席会议的久兆 300 份额、中小 300A 份额与中小 300B 份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持久兆 300 份额、中小 300A 份额与中小 300B 份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。按照基金份额持有人大会的决议，并经中国证监会备案，基金可以转换基金运作方式。因此，长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转换

为长城中证 500 指数增强型证券投资基金不存在法律障碍。

3、基金转型不存在技术障碍

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型为长城中证 500 指数增强型证券投资基金，基金登记机构由中国证券登记结算有限责任公司更换为长城基金管理有限公司。基金终止上市后，将进行基金份额变更登记。深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和基金登记机构已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。因此，基金转型不存在技术障碍。

4、调整投资目标、投资范围和投资策略的可行性

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型之后，必须对原有基金合同中的有关内容进行修订，使其在投资目标、投资范围及其投资组合比例限制、投资策略等方面符合法律法规的规定。

5、授权基金管理人修订基金合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同。修订后的基金合同需经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或授权代表签章，并报中国证监会备案。

五、基金转型的主要风险及预备措施

（一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，本次份额持有人大会需要本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的久兆 300 份额、中小 300A 份额与中小 300B 份额占权益登记日各自基金份额的 50%以上（含 50%） 方可召开。 为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

（二）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

（三）基金转型开放后遭遇大规模赎回的风险

为降低部分基金份额持有人在基金开放后大量赎回对基金平稳运作的影响，本基金在

转型期间将保证投资组合的流动性，以应对转型前后可能出现的较大赎回，降低净值波动率。

基金转型方案公告后，若出现基金折价率持续放大或基金净值剧烈波动等极端情况，基金管理人承诺将根据实际情况，加快转型进程，更早开放基金的日常赎回业务。

六、基金合同修改内容

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同的具体修改内容请参见本基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）公布的《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同修订对照表》。