关于长城久兆中小板300指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告

长城基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）旗下长城久兆中小板300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，包括久兆300份额、中小300A份额与中小300B份额）基金份额持有人大会表决投票时间自2018年6月5日起至2018年7月4日17:00止，会议期间审议了《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》（以下简称“本次会议议案”）。

本次会议议案于2018年7月5日获表决通过，持有人大会决议自该日起生效。我司于2018年7月6日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（www.szse.cn）和基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）发布《关于长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

根据本次持有人大会决议，现将本基金实施转型的相关事项提示如下：

一、转型选择期安排

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人将在本次基金份额持有人大会决议生效后、本基金正式转型前，预留至少二十个交易日的选择期供基金份额持有人做出选择。本基金转型选择期为2018年7月6日至2018年8月3日，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。基金份额持有人在本基金正式实施转型前，可选择赎回、转换转出久兆300份额或卖出中小300A份额、中小300B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、中小300B份额将依据相关规则转换成为长城中证500指数增强型证券投资基金（以下简称“长城中证500”）基金份额。

在选择期期间，由于本基金需应对赎回、转换转出等情况，基金份额持有人同意在选择期内豁免《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》中约定的投资组合比例等限制。基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及可根据实际情况暂停申购、赎回、日常转换或调整申购、赎回、日常转换的方式及限额等。

二、基金份额终止上市交易

为实施转型，基金管理人将根据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《长城

久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》、本次会议议案、《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大会表决结果暨决议生效公告》的有关规定向深圳证券交易所申请中小300A份额、中小300B份额终止上市。届时基金管理人将发布本基金中小300A份额、中小300B份额终止上市公告。

三、基金份额的转换及相关安排

1、转型选择期届满后，基金管理人将确定份额转换起始日（T日），从T日起开始办理本基金的份额转换业务，并在份额转换基准日（T+5日）完成基金份额转换。基金份额的转换主要分为以下二个步骤：

（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）在份额转换基准日（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份额。基金份额转换后，长城中证500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财产。由于基金份额数截位计算产生的误差，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的份额净值为1.0000元。

2、确权登记相关安排

本基金转型为长城中证500指数增强型证券投资基金后，原本基金基金份额将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。原本基金基金份额持有人需要对其持有的基金份额进行重新确认与登记（即确权登记），办理确权登记后，方可通过相关销售机构办理长城中证500指数增强型证券投资基金份额的赎回等业务。办理确权登记的具体时间和相关业务规则请见基金管理人届时发布的公告。

四、关于基金合同等法律文件的修订

根据相关法律法规及《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转型方案说明书》的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》、《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金托管协议》修订为《长城中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《长城中证500指数增强型证券投资基金托管协议》，并据此拟定了《长城中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》。上述文件已经中国证监会《关于准予长城久兆中小板300指数分级证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2018]820号文）准予变更注册。

五、长城中证500指数增强型证券投资基金份额的申购赎回

基金管理人将根据相关规定，在《长城中证500指数增强型证券投资基金基金合同》生效后，开放长城中证500指数增强型证券投资基金的日常申购、赎回等业务，具体请见基金管理人届时发布的公告。

六、对基金份额持有人的影响及转型后风险收益特征发生变化的提示

1、本基金转型前为股票型指数基金，长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金。转型前本基金基金份额的分级设置则决定了不

同份额类别具有不同的风险收益特征，其中中小300A份额具有低风险、低预期收益的特征，中小300B份额具有高风险、高预期收益的特征。转型后，长城中证500指数增强型证券投资基金为股票型指数基金，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，且不再设置风险收益特征不同的两类子份额。

2、转型后，本基金由跟踪中小板300（价格）指数的分级基金变为跟踪中证500指数的开放式基金，投资目标、投资范围、运作方式等发生变化，基金的风险收益特征也发生了一定的变化。转型后，原中小300A份额持有人持有的基金份额的预期风险水平可能提高，原中小300B份额持有人持有的基金份额的预期风险水平可能降低。同时，不同的销售机构采用的风险评价方法也不同，因此存在基金转型前后风险等级不一致的可能。

3、在基金份额的转换过程中，由于基金份额数取整或截位计算产生的误差，基金份额持有人将面临基金资产净值减小的风险，其中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。

特此公告

长城基金管理有限公司

2018年7月6日