长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金份额转换和变更登记的提示性公告

长城基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）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）发布了《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》与《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》。根据持有人大会决议，基金管理人将对长城久兆中小板300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，包括久兆300份额、中小300A份额与中小300B份额，基金代码分别为162010、150057、150058）进行份额转换与变更登记，份额转换与变更登记完成后，长城久兆中小板300指数分级证券投资基金将转型为长城中证500指数增强型证券投资基金（以下简称“长城中证500”，基金代码：006048），现将本基金实施份额转换与变更登记的相关事项提示如下：

一、基金份额转换

1、基金份额转换相关日期

（1）份额转换起始日：2018年8月6日

（2）份额转换基准日：2018年8月13日

2、基金份额转换对象

份额转换基准日登记在册的长城久兆中小板300指数分级证券投资基金的全部份额，包久兆300份额场外份额，以及由中小300A份额、中小300B份额转换而成的久兆300份额场内份额。

3、基金份额转换流程

（1）在份额转换起始日日终，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，份额转换基准日日终，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×份额转换基准日久兆300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。

4、基金份额转换结果的公告

本基金此次份额转换完成后，基金管理人将在指定媒介对份额转换结果予以公告。

如果基金份额转换过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理份额转换与变更登记。

二、基金份额变更登记

基金管理人将于份额转换基准日完成基金份额变更登记。在份额转换基准日日终，基金管理人将基金份额持有人持有的本基金基金份额变更登记为长城中证500指数增强型证券投资基金基金份额。

本基金转型为长城中证500指数增强型证券投资基金后，原登记在中国证券登记结算

有限责任公司深圳证券登记结算系统的本基金基金份额统一变更登记至长城基金管理有限公司登记系统。长城中证500指数增强型证券投资基金的注册登记机构为长城基金管理有限公司。

三、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并经长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会审议通过，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。

四、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。

五、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8月3日