长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金份额转换结果公告

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）经中国证监会准予变更注册，且《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》已获基金份额持有人大会审议通过，长城久兆基金在终止上市、份额转换与变更登记后转型为长城中证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）。

根据长城久兆基金份额持有人大会决议及《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》等相关文件，长城基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）对份额转换基准日（2018年8月13日）登记在册的长城久兆基金份额进行了份额转换，现将份额转换结果公告如下：

一、基金份额转换结果

表1、中小300A份额与中小300B份额转换成久兆300份额场内份额的转换结果

转换前基金份额名称	转换前份额参考净值(元)	转换前基金份额数量(份)	转换比例	转换后基金份额名称	转换后份额净值(元)	转换后基金份额数量(份)
中小300A	1.031	1,820,318.00	1.222955508	久兆300场内份额	0.843	4,550,794.00
中小300B	0.717	2,730,477.00	0.851362994			

表2、久兆300份额场内份额、久兆300份额场外份额转换成长城中证500份额的转换结果

转换前基金份额名称	转换前份额净值(元)	转换前基金份额数量(份)	转换比例	转换后基金份额名称	转换后份额净值(元)	转换后基金份额数量(份)
久兆300场内份额	0.876	6,118,546.00	0.875935480	长城中证500份额	1.0000	17,011,017.93
久兆300场外份额	0.876	13,301,854.59	0.875935480			

注：表2中“久兆300场内份额”包括原久兆300份额场内份额以及由中小300A份额、中

小 300B 份额转换而成的久兆 300 份额场内份额。

基金份额转换后，长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金份额持有人成为长城中证 500 指数增强型证券投资基金份额持有人，基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，转换后长城中证 500 指数增强型证券投资基金的份额净值为 1.0000 元。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。

自本公告披露之日起，原长城久兆基金份额持有人可查询经注册登记机构确认的转换后的长城中证 500 基金份额。

二、关于《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的生效

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。

《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》自长城久兆基金份额转换基准日，即 2018 年 8 月 13 日起生效，同日《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》失效。

三、长城中证 500 指数增强型证券投资基金的申购赎回

自《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效之日（即 2018 年 8 月 13 日）起不超过三个月，长城中证 500 指数增强型证券投资基金将开放日常申购、赎回等业务，具体日期请见本基金管理人届时发布的公告。

四、风险提示

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。

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。

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。

本基金管理人承诺以诚实信用、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。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于本基金前应认真阅读《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招募说明书》等法律文件以及《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》、《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》等公告中的相关规定，了解拟投资基金的转型安排和风险收益特征变化，并结合投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否与自身的风险承受能力相匹配。

特此公告

长城基金管理有限公司

2018 年 8 月 15 日