

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算 的风险提示公告

根据《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”）、《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）中关于不定期份额折算的相关规定，当长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之积极份额（场内简称：中小 300B，基金代码：150058）的份额参考净值在某一开放日小于或等于 0.250 元时，长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称：长城久兆，基金代码：162010）、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之稳健份额（场内简称：中小 300A，基金代码：150057）、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之积极份额（场内简称：中小 300B，基金代码：150058）将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2015 年 9 月 2 日，中小 300B 的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件，因此本基金管理人敬请投资者密切关注中小 300B 近期的参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、由于中小 300A、中小 300B 折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，中小 300A、中小 300B 的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

二、中小 300B 表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阈值当日，中小 300B 的份额参考净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日中小 300B 的份额参考净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。

四、中小 300A 表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后中小 300A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的中小 300A 变为同时持有较低风险收益特征的中小 300A 与较高风险收益特征的长城久兆份额的情况，因此中小 300A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示：

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量长城久兆份额、中小 300A、中小 300B 的持有人

存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停中小 300A 与中小 300B 的上市交易和长城久兆份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解本基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及招募说明书或者拨打本基金管理人客服电话：400-8868-666（免长途话费）。

特此公告

长城基金管理有限公司

2015 年 9 月 7 日