长城久兆中小板300指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

二〇一一年十二月

重 要 提 示

本基金经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。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。投资本基金可能遇到的风险包括:市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作风险、合规风险、指数投资风险、杠杆机制风险、折溢价交易风险,以及份额配对转换与基金份额折算等业务办理过程中的特有风险等等。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")等有关法律法规及《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")编写。

本招募说明书阐述了长城久兆中小板300指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金基金合同。

二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1.基金或本基金:指长城久兆中小板300指数分级证券投资基金

2.基金管理人:指长城基金管理有限公司

3.基金托管人:指中国建设银行股份有限公司

4.基金合同或本基金合同:指《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5.托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6.招募说明书:指《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7.基金份额发售公告:指《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金份额发售公告》

8.上市交易公告书:指《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之久兆稳健份额与久兆积极份额上市交易公告书》

9.法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10.《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11.《销售办法》:指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12.《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13.《运作办法》:指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14.中国证监会:指中国证券监督管理委员会

15.银行业监督管理机构:指中国人民银行和或中国银行业监督管理委员会

16.上市交易所:指深圳证券交易所

17.中小板300(价格)指数:指在深圳证券交易所中小企业板市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,以综合反映中小企业板整体走势。中小板300指数由深圳证券信息有限公司编制并发布

18.基金份额分类:指本基金的基金份额包括长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之基础份额、长城久兆中小板300指数证券投资基金之稳健份额和长城久兆中小板300指数证券投资基金之积极份额。其中,长城久兆中小板300指数证券投资基金之稳健份额和长城久兆中小板300指数证券投资基金之积极份额的基金份额配比始终保持4:6的比例不变

19.久兆300份额:指长城久兆中小板300指数证券投资基金之基础份额

20.久兆稳健份额:指本基金份额按照基金合同约定规则所分离的稳健收益类基金份额,即长城久兆中小板300指数证券投资基金之稳健份额

21.久兆积极份额:指本基金份额按照基金合同约定规则所分离的积极收益类基金份额,即长城久兆中小板300指数证券投资基金之积极份额

22.基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

23.个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

24.机构投资者:指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

25.合格境外机构投资者:指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

26.投资人:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人,的合称

27.基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

28.基金销售业务:指基金管理人或代销机构宣传推介基金、发售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

29.销售机构:指直销机构和代销机构

30.直销机构:指长城基金管理有限公司

31.代销机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构

32.基金销售网点:指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

33.场外:指通过深圳证券交易所外的销售机构办理本基金基金份额的认购、久兆300份额的申购和赎回的场所

34.场内:指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、久兆稳健份额与久兆积极份额上市交易、久兆300份额的申购和赎回的场所

35.注册登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

36.注册登记机构:指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为长城基金管理有限公司或接受长城基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

37.注册登记系统:指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

38.证券登记结算系统:指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

39.场外份额:指登记在注册登记系统下的基金份额

40.场内份额:指登记在证券登记结算系统下的基金份额

41.基金账户:指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

42.基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

43.基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期

44.基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

45.基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月

46.存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

47.运作周年:指自基金合同生效日或前一定期份额折算日次日起至满一年的运作期间

48.工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

49.T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

50.T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

51.开放日:指为投资人办理久兆300份额申购、赎回或其他业务的工作日

52.交易时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

53.《业务规则》:指长城基金管理有限公司开放式基金业务规则,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守

54.认购:指在基金募集期内,投资人申请购买基金份额的行为

55.申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

56.赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

57.份额配对转换:指根据基金合同的约定,本基金场内的久兆300份额与久兆稳健份额、久兆积极份额之间的配对转换,包括分拆与合并两个方面

58.分拆:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每十份久兆300份额的场内份额申请转换成四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额的行为

59.合并:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额进行配对申请转换成十份久兆300份额的场内份额的行为

60.上市交易:指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖久兆稳健份额、久兆积极份额的行为

61.基金转换:指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公布规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

62.转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作。转托管包括系统内转托管和跨系统转登记

63.系统内转托管:指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为

64.跨系统转登记:指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为

65.定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

66.巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%

67.元:指人民币元

68.基金利润:指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额;基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额

69.基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

70.基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

71.基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

72.基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

73.指定媒体:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

74.不可抗力:指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的、使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件。证券交易所非正常暂停或停止交易

三、基金管理人

(一)基金管理人情况

1.名称:长城基金管理有限公司

2.住所:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

3.办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

4.法定代表人:杨光裕

5.组织形式:有限责任公司

6.设立日期:2001年12月27日

7.电话:0755-23982338 传真:0755-23982328

8.联系人:袁柳生

9.管理基金情况:目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城久利股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金和长城积极增利债券型证券投资基金十三只基金

10.客户服务电话:400-8868-666

11.注册资本:壹亿伍仟万元

12.股权结构:

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

(二)基金管理人主要人员情况

1.董事、监事及高管人员介绍

①董事

杨光裕先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任、长城证券有限责任公司副总裁,现任长城基金管理有限公司董事长。

何伟先生,中共党员,硕士研究生。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司,1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理,国泰君安证券股份有限公司总裁助理,华富基金管理有限公司(筹)副总经理,国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。现任长城证券有限责任公司总裁。

范小新先生,中共党员,经济学博士,高级经济师。1986年7月参加工作,历任重庆市对外经济贸易委员会副处长、西南技术进出口公司总经理助理,重庆对外经贸委美国公司筹备组组长,中国机电产品进出口商会法律部副主任,华能资本服务有限公司总经理工作部副经理。现任长城证券有限责任公司董事会秘纪委书记、党委委员。

梁宇峰先生,中共党员,复旦大学经济学博士。历任东方证券股份有限公司研究发展总部经理助理、办公室主任助理、研究所副所长,2006年4月至今任东方证券股份有限公司研究所所长。

姬宏俊先生,中共党员,研究生学历,工商管理硕士。历任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长,发展计划委员会财政金融处副处长,国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。现任中原信托有限公司副总裁。

陆妍女士,1991年毕业于天津理工学院管理信息系统专业,获工学学士学位,1997年毕业于天津大学管理学院,获工学硕士学位。曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券投资部项目经理、北方国际信托股份有限公司证券管理总部总经理,现任北方国际信托股份有限公司副总经理。

万建华先生,中共党员,工商管理博士,高级经济师。历任中国人民银行货币政策司处长、招商银行总行副行长、党委副书记、常务副行长、中国银联筹备组组长、党委书记、副董事长、总裁,上海国际集团党委副书记、副董事长、总裁。现任国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长。

谢志华先生,中共党员,经济学博士。历任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商业学校教师、北京商学院(现北京工商大学)副院长、北京工商大学校长助理。2003年至今任北京工商大学副校长。

刘彩先生,经济学博士。曾任中华工商时报社海外部编辑、副主任、中华工商时报财经新闻部主任,中国人民银行深圳分行金融早报社总编辑,中华工商时报社总编辑助理,现任中华工商时报社副总编辑,兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

谭亦衡先生,中共党员,经济学博士。曾任职于国家发展改革委员会,历任南方证券国际部总经理、南方证券咨询公司董事长、南方证券香港公司副董事长,香港汇南财务有限公司董事副总经理、招银国际董事副总经理、长城证券公司董事,招商银行董事,招商证券监事长。现任交银国际控股有限公司首席执行官兼副董事长。

②监事

吴礼信先生,中共党员,会计师,中国注册会计师(非执业)。历任安徽省地矿局三二六地质队会计主管,深圳中达信会计师事务所审计一部部长,大鹏证券有限责任公司计财综合部经理,大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理,第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券有限责任公司,任财务部总经理,现任长城证券有限责任公司财务总监,并担任长城基金管理有限公司监事会主席。

王燕滨先生,中共党员,工商管理硕士,高级经济师。历任内蒙银行学校教师、校团委书记、学生科科长、教研室主任,内蒙古证券公司发行部经理,上海业务部总经理、总经理助理、副总经理,海通证券天津、北京营业部总经理、北方信托业务二部总经理,公司总经理助理兼信托业务二部总经理。现任北方信托总经理助理兼资产管理部总经理。

张令先生,中共党员,研究生学历。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师,上海浦发银行信托证券部科长、副总经理,东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理,现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。

孟凡君先生,中共党员,经济学士,经济师。历任工商银行河南华信资金市场融资二部经理、总经理助理、中原信托投资有限公司开封证券营业部副经理、资产管理部经理,现任中原信托有限公司投资管理二部经理。

桑煜先生,中共党员,经济学士。曾任职于中国建设银行山东日照市分行,中国建设银行山东省分行,中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司,历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理、市场开发部总经理,综合管理部总经理,现任公司总经理助理兼运行保障部总经理。

张静女士,中共党员,2005年毕业于南开大学,法学硕士。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员,2007年5月至今,任长城基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。

③高级管理人员

杨光裕先生,长城基金管理有限公司董事长,简历同上。

熊科金先生,经济学硕士。历任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人,中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人,华夏证券有限公司江西管理总部总经理,中国银河证券有限责任公司基金部负责人、银河基金管理有限公司筹备组负责人,银河基金管理有限公司副总经理、总经理。2011年7月进入长城基金管理有限公司,现任公司总经理。

余骏先生,硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经管学院,历任中国人民银行湖北省分行科室负责人,君安证券有限公司研究部宏观室负责人,长城证券有限责任公司营业部总经理,长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理,长城基金管理有限公司副总经理兼运行保障部总经理和综合管理部总经理,长城基金管理有限公司副总经理兼市场开发部总经理,现任公司副总经理。

彭洪波先生,经济学硕士、工学学士、MBA。曾就职于长城证券有限责任公司,历任深圳东园路营业部电脑部经理,公司电子商务筹备组项目经理,公司审计部技术主审。2002年3月加盟长城基金管理有限公司,历任监察稽核部业务主管、部门副经理、部门经理,公司督察长,现任公司总经理助理兼监察稽核部总经理,并代为履行公司督察长职责。

2.本基金基金经理简历

陈硕先生,南开大学生物化学学士、美国乔治敦大学生物化学及分子生物学硕士、美国马里兰大学应用计算机硕士、宾西法尼亚大学沃顿商学院工商管理硕士。具有7年证券从业经历。2004年1月至2008年2月就职于美国巴克莱资本公司,从事全球公司债券及衍生物交易管理,历任经理、副董事。2008年进入长城基金管理有限公司,2008年4月至2009年5月任国际业务部高级研究员,从事宏观策略、行业及上市公司研究工作。自2009年5月至今任"久嘉证券投资基金"基金经理。

3.本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

余骏先生,投资决策委员会委员,代理投资决策委员会主席、公司副总经理。

杨建华先生,投资决策委员会执行委员,投资总监兼基金管理部总经理。

杨毅平先生,投资决策委员会委员,公司首席策略分析师。

秦玲萍女士,投资决策委员会委员,公司研究部总经理。

4.上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1.基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利包括但不限于:

①以本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;

②依照本基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

③攻售基金份额;

④依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

⑤在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;

⑥根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

⑦在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理久兆300份额申购和赎回申请;

⑧在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;

⑨自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

⑩选择、更换代销机构,并依据销售代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;

⑪选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

⑫在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

⑬依法召集基金份额持有人大会;

⑭法律法规和基金合同规定的其他权利。

(二)基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:

①依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

②办理基金备案手续;

③自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

④配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

⑤建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

⑥除依据《基金法》及基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

⑦公正地分配基金财产的收益;

⑧按照规定计算基金份额的申购、赎回价格;

⑨采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

⑩按规定受理久兆300份额申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

⑪进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

⑫编制中期和年度基金报告;

⑬严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

⑭保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

⑮按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

⑯依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

⑰保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

⑱以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

⑲组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

⑳因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

㉑基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

㉒按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

㉓面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

㉔执行生效的基金份额持有人大会决议;

㉕不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

㉖依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

㉗法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(三)基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的权利为:

①依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

②监督基金管理人对本基金的投资运作;

③自本基金合同生效之日起,依法保管基金资产;

④在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;

⑤根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

⑥依法召集基金份额持有人大会;

⑦按规定取得基金份额持有人名册资料;

⑧法律法规和基金合同规定的其他权利。

(四)基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的义务为:

①安全保管基金财产;

②设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;

③对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立;

④除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;

⑤保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

⑥按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

⑦保守基金商业秘密,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

⑧对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

⑨保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

⑩按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

⑪办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

⑫复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值和久兆300份额申购、赎回价格;

⑬按照规定监督基金管理人的投资运作;

⑭按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

⑮依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

⑯按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

⑰因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

⑱基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;

⑲参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

⑳面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行业监督管理机构,并通知基金管理人;

㉑执行生效的基金份额持有人大会决议;

㉒不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

㉓建立并保存基金份额持有人名册;

㉔法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(五)基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的权利为:

①分享基金财产收益;

②参与分配清算后的剩余基金财产;

③依法转让其持有的久兆稳健份额与久兆积极份额,依法申请赎回其持有的久兆300份额;

④按照规定要求召开基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

⑤出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

⑥查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

⑦监督基金管理人的投资运作;

⑧对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

⑨法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

(六)基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的义务为:

①遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;

②交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;

③在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;

④不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;

⑤执行生效的基金份额持有人大会决议;

⑥返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;

⑦法律法规和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的授权代表在授权范围内有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。基金份额持有人大会的审议事项应分别由久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

(二)召开事由

1.当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人、单独或合计持有久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上(含10%,下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)提议时,应当召开基金份额持有人大会:

①终止基金合同;

②转换基金运作方式;

③变更基金类别;

④变更基金投资目标、投资范围或投资策略;

⑤变更基金份额持有人大会程序;

⑥更换基金管理人、基金托管人;

⑦提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;

⑧本基金与其他基金的合并;

⑨终止久兆稳健份额与久兆积极份额的运作;

⑩对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;

⑪法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2.出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同,不需召开基金份额持有人大会:

①调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;

②在法律法规和本基金合同规定的范围内变更久兆300份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率;

③因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

④对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;

⑤基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

⑥按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(三)召集人和召集方式

1.除法律法规或本基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。

2.基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集。

3.单独或合计代表久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,单独或合计代表久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开。

4.单独或合计代表久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集,单独或合计代表久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前30日向中国证监会备案。

5.基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

(四)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1.基金份额持有人大会的召集人(以下简称"召集人")负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前30日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

①会议召开的时间、地点和出席方式;

②会议拟审议的主要事项;

③会议形式;

④议事程序;

⑤有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;

⑥代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等),送达时间和地点;

⑦表决方式;

⑧会务常设联系人姓名、电话;

⑨出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

⑩召集人需要通知的其他事项。

2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3.如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

(五)基金份额持有人出席会议的方式

1.会议方式

①基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

②现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。

③通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

④会议的召开方式由召集人确定。

2.召开基金份额持有人大会的条件

①现场开会方式

在同时符合以下条件时,现场会议方可举行:

1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

2)召集人按基金合同规定通知基金托管人或和基金管理人(分别或共同称为"监督人")到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

4)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、久兆稳健份额与久兆积极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;

5)直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与注册登记机构记录相符。

(六)议事内容与程序

1.议事内容及提案权

①议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

②基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

③对于基金份额持有人提交的提案,大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,