长城久兆中小板300指数分级证券投资基金招募说明书

(上接 C11 版)

住所:北京市西城区金融大街 25 号
办公地址:北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码:100033
法定代表人:张建国 (代行)
成立日期:2004 年 09 月 17 日
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字 [1998]12 号
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
存续期间:持续经营

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期、长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保管箱服务;经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

(二)基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1.基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中小板 300 (价格)指数的成份股及其备选成份股、新股 (一级市场初次发行或增发)、债券、资产支持证券、权证,以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会相关规定)。

本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%,其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300 (价格)指数的成份股及其备选成份股,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,进行组合资产管理。

2.基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

(1) 本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%,其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300 (价格)指数的成份股及其备选成份股,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

(2) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%。

(3) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券不得超过基金资产净值的 10%;本基金持有的全部资产支持证券市值不得超过基金资产净值的 20%。

(4) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(5) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%。

(6) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定,基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性,并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生,如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时,基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易,基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生,只能进行事后结算,基金托管人不承担由此造成的损失,并向中国证监会报告。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新,新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的,应向基金托管人说明理由,并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失,基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人可以对相应损失先行予以承担,然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5.基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券,应事先根据中国证监会相关规定,明确基金投资流通受限证券的比例,制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

(1)本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管,并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下,基金管理人负责相关工作的落实和协调,并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题,造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失,及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失,由基金管理人承担。

本基金投资受限证券,不得预付任何形式的保证金。

(2) 基金管理人投资非公开发行股票,应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施,以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责,确保对相关风险采取积极有效的措施,在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时,基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算,并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险,基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的,基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

(3)本基金投资非公开发行股票,基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料,并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整,基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于:

1)中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

2)非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

4)基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

(4)基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定,在合理期限内未能进行及时调整,基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书,予以公告。

(5)基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督:

1)本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

2)在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

3)有关比例限制的执行情况。

4)信息披露情况。

(6)相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的,从其规定。

6. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、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计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7. 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

8.基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9.若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,由此造成的损失由基金管理人承担。

10.基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

(三)基金管理人对基金托管人的业务核查

1. 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核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,根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2. 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

3. 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金托管人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。

(四)基金财产的保管

1.基金财产保管的原则

(1)基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2)基金托管人应安全保管基金财产。

(3)基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

(4)基金托管人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。

(5)基金托管人根据基金管理人的指令,按照基金合同和本协议的约定保管基金财产,如有特殊情况双方可另行协商解决。

(6)对于因为基金投资产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金财产没有到达基金账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失,基金托管人对此不承担任何责任。

(7)除依据法律法规和基金合同的规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2.基金募集期间及募集资金的验资

(1)基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的"基金募集专户"。该账户由基金管理人开立并管理。

(2)基金募集期满或基金停止募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户,同时在规定时间内,聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3)若基金募集期限届满,未能达到基金合同生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3.基金银行账户的开立和管理

(1)基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户,并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2)基金银行账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他资金账户;亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3)基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4)在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

4.基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1)基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2)基金证券账户的开立和使用,仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户,亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3)基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责,账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4)基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作,基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5)若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开立、使用的,若无相关规定,则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

5.债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

6.其他账户的开立和管理

(1)因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和基金合同的规定,由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

(2)法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

7.基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库,也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让,由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

8.与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署,由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外,基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同,基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人,并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

(五)基金资产净值计算与复核

1.基金资产净值

本基金分别计算并公告久兆 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。

(1)久兆 300 份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

久兆 300 份额的基金份额净值计算公式为:

T 日久兆 300 份额的基金份额净值=T 日闭市后的基金资产净值/T 日本基金 (包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额)的基金份额余额总数

(2)久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值计算

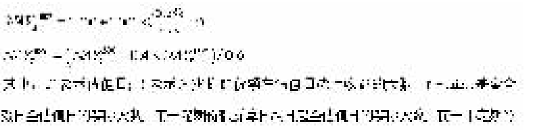
1)本基金四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额的参考净值之和将等于十份久兆 300 份额的净值。

2)久兆稳健份额的约定年收益率为 5.8%。久兆稳健份额的约定年收益率除以 365 得到久兆稳健份额的约定日简单收益率。久兆稳健份额的基金份额参考净值以基金合同生效日或前一份额折算日经折算后的份额净值为基准采用久兆稳健份额的约定日简单收益率单利进行计算。久兆稳健份额在估值日应计收益的天数为自基金合同生效日或前一份额折算日 (定期份额折算日或不定期份额折算日)次日起至估值日的实际天数。

3)计算出久兆稳健份额的份额参考净值后,根据久兆稳健份额、久兆积极份额和久兆 300 份额净值的关系,计算出久兆积极份额的份额参考净值。

4) 本基金进行定期份额折算或不定期份额折算操作以后,久兆稳健份额、久兆积极份额的份额参考净值计算方法保持不变。

5) 久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值计算公式



基金管理人每个工作日计算基金资产净值、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,经基金托管人复核,按规定公告。

2.复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,将久兆 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结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

3.根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致意见的,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

(六)基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册,包括《基金合同》生效日、久兆稳健份额与久兆积极份额上市交易的前一日、久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作日、基金份额折算日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册由基金管理人自基金注册登记机构取得后,转交给基金托管人。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额名称与基金份额。

本基金的基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

(七)争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议,双方当事人应通过协商、调解解决,协商、调解不能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为北京市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

(八)托管协议的修改与终止

1.托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

2.基金托管协议终止出现的情形

(1)基金合同终止;
(2)基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
(3)基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;
(4)发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

二十六、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务,基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

(一)持有人交易资料的寄送服务

1.注册登记人保留持有人名册上列明的所有持有人的基金交易记录。

2.每季度结束后 10 个工作日内,注册登记人向本季度有交易的投资者寄送对账单。

3. 每年度结束后 10 个工作日内,注册登记人向所有持有本基金份额的投资者或在最后一个季度内有交易的投资者寄送对账单。

(二)客户服务中心 (Call Center)24 小时电话服务,提供查询、咨询、投诉受理等业务

公司网站:www.ccfund.com.cn
客服邮箱:support@ccfund.com.cn
客服电话:400-8868-666

二十七、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。招募说明书条款及内容应以招募说明书正本为准。

投资者还可以登录基金管理人的网站 (http://www.ccfund.com.cn)查阅和下载本招募说明书。

二十八、备查文件

(一)中国证监会批准长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金设立的文件
(二)《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》
(三)《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金托管协议》
(四)法律意见书
(五)基金管理人业务资格批件、营业执照
(六)基金托管人业务资格批件、营业执照
(七)中国证监会规定的其他文件

长城基金管理有限公司
二○一一年十二月十二日

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金份额发售公告

(上接 C9 版)

③税务登记证原件及加盖公章的复印件;
④加盖公章的法定代表人证明书及法定代表人有效身份证件复印件;
⑤基金业务法定代表人授权委托书;
⑥业务经办人有效身份证件原件及复印件;
⑦印鉴卡一式三份;
⑧指定银行账户的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》原件及复印件 (或指定银行出具的开户证明);
⑨加盖公章的《证券投资基金投资人权益须知》一份;
⑩加盖公章的《机构客户风险承受能力测评》一份;
加盖银行业务章的汇款凭证复印件;
填妥并加盖单位公章的基金开户申请表和基金认购申请表 (加盖预留印鉴章)。

注:在本直销机构认购基金的机构投资者需指定一家商业银行开立的银行账户作为投资者赎回、分红及无效认 (申)购的资金退款等资金结算汇入账户。此账户可为投资者在任一商业银行的存款账户。

(3)注意事项

若机构投资者认购资金在当日 16:30 之前未到本公司指定直销资金专户的,则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期 (即有效申请日)以资金到账日为准。

(四)通过中国建设银行办理开户和认购的程序

1、个人投资者

(1)受理开户和认购的时间:基金发售日的 9:30—17:00 (周六、周日及法定节假日不办理业务)。

(2)开户程序及所需材料

① 请事先办妥或持有中国建设银行理财卡或龙卡通并存入足额开户和认购资金;
② 请到网点提交以下材料,办理开户手续,开立长城基金管理有限公司的基金账户:
A. 本人有效身份证件原件 (包括:居民身份证、军官证、士兵证等);
B. 本人的中国建设银行理财卡或龙卡通;
C. 填妥的"个人开通/取消证券交易申请表"。
③ 开户同时可办理认购手续,需填妥并提交"证券买入 (基金认购/申购)委托单"。

(3)认购程序及所需材料

① 本人有效身份证件原件;
② 填妥的"证券买入 (基金认购/申购)委托单"。

(4)注意事项

① 请个人投资者本人到中国建设银行指定的代销网点办理开户和认购手续;
② 有关详细的办理手续,请查阅代销网点摆放的《中国建设银行证券业务系统个人客户操作指南》。

2、机构投资者

(1)受理开户和认购的时间:基金发售日的 9:30—15:30 (周六、周日及法定节假日不办理业务)。

(2)开户及认购程序

① 事先办妥或持有中国建设银行的机构活期存款账户并存入足额开户和认购资金;
② 由被授权人到开户会计柜台提交以下材料,办理开户手续,开立长城基金管理有限公司的基金账户:
A. 机构活期存款账户的印鉴卡及印鉴、营业执照或事业社团法人证书及复印件、军队或武警开户许可证及复印件、组织机构代码证及复印件。开户单位为分支机构的,还应提交法人授权其开户的书面证明;
B. 证券业务授权书;
C. 被授权人有效身份证明及复印件、印鉴;
D. 填妥的"机构开通/取消证券交易申请表",并加盖公章和法定代表人章。
③ 开户同时可办理认购手续,请填妥并提交"证券买入 (基金认购/申购)委托单"。

(3)认购程序及所需材料

A. 被授权人有效身份证明原件;
B. 填妥的"证券买入 (基金认购/申购)委托单"。

(4)注意事项

① 机构投资者请到原机构活期存款账户开户会计柜台办理开户和认购手续;
② 若有其他方面的要求,请以中国建设银行《中国建设银行证券业务系统机构客户操作指南》为准。

(五)通过其他代销机构办理开户和认购的程序

投资者在其他代销机构办理开户及认购手续以各代销机构的规定为准。

四、场内认购的开户与认购程序

(一)场内认购使用账户说明

1、投资者办理场内认购时,需具有深圳证券账户。其中,深圳证券账户是指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户 (即深圳 A 股账户)或证券投资基金账户。

2、已有深圳证券账户的投资者无须再办理开户手续。

3、尚无深圳证券账户的投资者,需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构开立账户。具体账户开立手续请参见中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的相关业务规则以及中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司各开户代理机构网点的说明。

(二)场内开户及认购的程序

1、受理场内认购的时间:基金份额发售日 9:30-11:30 和 13:00-15:00 (周六、周日和节假日不受理)。

2、开户及认购手续

(1)开立证券账户。投资者应开立深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户。

(2)开立资金账户。投资者应在场内销售机构的业务网点开立资金账户,并在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3)认购。投资者可通过场内销售机构认可的各种方式在投资者开立资金账户的场内销售机构各业务网点申报认购委托,可多次申报认购,但不可撤单,申报一经确认认购资金即被冻结。

具体业务办理流程及规则参见办理场内认购的各销售机构的相关说明。

五、无效认购

(一)基金募集期结束,以下情况将被认定为无效认购:

1、投资者划来资金,但逾期未办理开户手续或开户不成功的;
2、投资者划来资金,但逾期未办理认购手续的;
3、投资者划来的认购资金少于其申请的认购金额的;
4、本公司确认的其它无效资金或认购失败资金。

(二)投资者无效认购的资金将于本基金认购结束后三个工作日内划往投资者指定账户。

六、清算与交割

(一)本基金《基金合同》生效前,全部认购资金将被冻结在本基金的募集专户中,投资者的认购资金在本基金募集期间形成的利息收入折算成基金认购份额,归投资者所有,认购资金利息以基金注册登记机构的确认结果为准。

(二)投资者无效认购资金或未获得确认的认购资金将于基金注册登记机构确认为无效后 3 个工作日内划入投资者指定账户。

(三)基金募集结束后,基金注册登记机构将根据相关法律法规以及业务规则和基金合同的约定,完成基金份额持有人的权益登记。

七、基金的验资与基金合同生效

对投资者募集期截止后,由银行出具基金募集专户存款证明,由基金管理人委托具有资格的会计师事务所对认购资金进行验资并出具验资报告,基金注册登记人出具认购户数证明。

若基金合同生效,基金管理人发布基金合同生效公告。

若基金募集失败,本基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期后 30 个工作日内划出,退还基金认购人。

八、本次募集当事人及中介机构

(一)基金管理人
名称:长城基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
法定代表人:杨光裕
电话:0755-23982338
传真:0755-23982328
联系人:袁柳生

(二)基金托管人
名称:中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 25 号
办公地址:北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
法定代表人:张建国 (代行)
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(三)销售机构

1、直销机构

(1)长城基金管理有限公司深圳直销中心
地址:深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
电话:0755-23982244
传真:0755-23982259
联系人:黄念英

(2)长城基金管理有限公司北京直销中心
地址:北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心大厦 916、917 室
电话:010-88091157
传真:010-88091075
联系人:王玲

(3)长城基金管理有限公司上海直销中心
地址:上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1804 室
电话:021-51150756
传真:021-51150756
联系人:邱文勋

(4)网上直销
个人投资者可以通过本公司网上直销交易平台办理本基金的开户和认购手续,具体交易细则请参阅本公司网站相关信息。
网址:https://www.ccfund.com.cn/etrading/

2、场外代销机构

(1)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 25 号
办公地址:北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
法定代表人:张建国 (代行)
电话:010-66275654
传真:010-66275654

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同摘要

(上接 C9 版)

3.基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。

4.采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6.基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(八)计票

1.现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点,由大会主持人当场公布计票结果。

(3)如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2.通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证;如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议,召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第 2 条所规定的第 1)-9)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行,关于本章第 2 条所规定的第 10)、11)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

2.生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3.基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一)基金收益的构成

本基金合同项下基金收益即基金利润,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。

(二)基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(三)收益分配原则

本基金 (包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额)不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过,并经中国证监会核准后如果终止久兆稳健份额与久兆积极份额的运作,本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

(一)基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times$年管理费率$\div$当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(二)基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times$年托管费率$\div$当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值