# 长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之久兆稳健与久兆积极基金份额上市交易公告书

**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**
**注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司**
**上市地点:深圳证券交易所**
**上市时间:2012年2月21日**
**公告日期:2012年2月16日**

## 一、重要声明与提示

《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之久兆稳健与久兆积极基金份额上市交易公告书》(以下简称"本公告书")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内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,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")管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之久兆稳健与久兆积极基金份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2011年12月12日刊登于《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》及长城基金管理有限公司网站(www.ccfund.com.cn)的《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金招募说明书》。

## 二、基金概览

1、基金名称:长城久兆中小板300指数分级证券投资基金
基金简称:长城久兆中小300指数分级;场内简称:长城久兆;基金代码:162010
基金简称:久兆稳健份额;场内简称:久兆稳健;交易代码:150057
基金简称:久兆积极份额;场内简称:久兆积极;交易代码:150058
2、基金类型:股票型
3、基金运作方式:契约型开放式
4、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")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(场内简称:长城久兆)、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:久兆稳健)与长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之积极份额(场内简称:久兆积极)。其中,久兆稳健份额和久兆积极份额的基金份额比例始终保持在4:6不变。
5、本基金的存续期限为不定期。
6、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,场外认购的全部份额将确认为长城久兆份额;场内认购的全部份额将按照4:6的比例确认为久兆稳健份额与久兆积极份额。本基金基金合同生效后,长城久兆份额设置单独的基金代码,只接受场外与场内申购和赎回;久兆稳健份额、久兆积极份额交易代码不同,只上市交易,不接受申购和赎回。
7、长城久兆份额的申购与赎回:投资者可通过场外或场内两种方式对长城久兆份额进行申购与赎回。长城久兆份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司(深圳)开放式基金账户办理长城久兆份额场外申购、赎回业务。长城久兆份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户,通过深圳证券交易所交易系统办理长城久兆份额场内申购、赎回业务。久兆稳健与久兆积极将不接受投资者的申购与赎回。
8、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的长城久兆份额与久兆稳健份额、久兆积极份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每十份长城久兆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。合并指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长城久兆份额的场内份额的行为。份额配对转换自久兆稳健份额、久兆积极份额上市交易后不超过6个月的时间内开始办理,有关份额配对转换的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。
9、定期份额折算
本基金将在每个基金运作周年(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)的最后一个工作日对长城久兆份额和久兆稳健份额进行定期份额折算。本基金进行定期份额折算后,久兆稳健份额期末的约定应得收益将折算为场内长城久兆份额分配给久兆稳健份额持有人,久兆稳健份额的份额参考净值调整为1.000元;长城久兆份额持有人持有的每十份长城久兆份额将按四份久兆稳健份额获得新增长城久兆份额的分配,持有场外长城久兆份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外长城久兆份额的分配,持有场内长城久兆份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内长城久兆份额的分配。经过定期份额折算,长城久兆份额的份额净值相应进行调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。
10、不定期份额折算
当长城久兆份额的份额净值达到2.000元时,或当久兆积极份额的份额参考净值达到0.250元时,基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金进行不定期份额折算,不定期份额折算后,久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比始终保持4:6的比例不变,长城久兆份额的基金份额净值以及久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值均调整为1.000元。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。
11、基金份额上市:本基金合同生效后,投资者在场内认购的全部份额将按照4:6的比例自动分拆为久兆稳健份额与久兆积极份额,久兆稳健份额与久兆积极份额将同时在深圳证券交易所上市交易。
12、基金份额总额:截至2012年2月14日,本基金的基金份额总额为965,942,785.13份,其中,长城久兆为919,797,702.13份,久兆稳健为18,458,033.00份,久兆积极为27,687,050.00份。
13、基金份额净值:截至2012年2月14日,长城久兆的基金份额净值为1.001元,久兆稳健的基金份额参考净值为1.003元,久兆积极的基金份额参考净值为1.000元。
14、本次上市交易的基金份额简称:久兆稳健、久兆积极
15、本次上市交易的基金份额总额:久兆稳健18,458,033.00份;久兆积极27,687,050.00份
16、本次上市交易的基金份额交易代码:久兆稳健为150057;久兆积极为150058
17、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
18、上市交易日期:2012年2月21日
19、基金管理人:长城基金管理有限公司
20、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
21、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

## 三、基金份额的募集与上市交易

(一)上市前基金募集情况
1、本基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1474号
2、基金运作方式:契约型开放式
3、基金合同期限:不定期
4、本基金发售日期:2011年12月19日至2012年1月17日
5、发售价格:1.00元人民币
6、份额发售方式:本基金通过场外、场内两种方式公开发售
7、发售机构
(1)场外发售机构
1)直销机构:长城基金管理有限公司
2)代销机构:中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、兴业证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、中航证券有限公司、华泰证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、恒泰证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、日信证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、华融证券股份有限公司、国海证券有限责任公司。
(2)场内发售机构
具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位(会员单位名单详见深圳证券交易所网站)。
8、验资机构名称:安永华明会计师事务所
9、募集资金总额及入账情况
此次募集扣除认购费后的净认购金额(不含利息)为人民币965,751,817.91元,确认份额(不含利息转份额)965,751,817.91份,利息结转份额190,967.22份,总确认份额为965,942,785.13份。
上述有效净认购资金及其已结的银行利息已于2012年1月30日全额划入本基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的托管专户。
根据《基金合同》的约定,本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,场外认购的全部份额确认为长城久兆份额;场内认购的全部份额按4:6的比例确认为久兆稳健份额与久兆积极份额。按照每份基金份额1.00元计算,本基金募集期间含本息共募集965,942,785.13份基金份额,其中场外认购的基金份额确认为919,797,702.13份长城久兆份额;场内认购的基金份额按4:6的比例确认为18,458,033.00份久兆稳健份额和27,687,050.00份久兆积极份额。
10、基金备案情况
本基金已于2012年1月30日验资完毕,当日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2012年1月30日获书面确认,本基金《基金合同》自该日起正式生效。
11、基金合同生效日:2012年1月30日
12、基金合同生效日的基金份额总额:965,942,785.13份,其中,长城久兆为919,797,702.13份,久兆稳健为18,458,033.00份,久兆积极为27,687,050.00份。
(二)长城久兆的日常申购、赎回情况
长城久兆日常申购开放日:2012年2月21日。
长城久兆日常赎回开放日:2012年2月21日。
(三)久兆稳健与久兆积极上市交易的主要内容
1、本基金的久兆稳健与久兆积极上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2012]33号
2、上市交易日期:2012年2月21日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、上市交易份额简称:久兆稳健、久兆积极
5、交易代码:久兆稳健为150057、久兆积极为150058
6、本次上市交易份额(截至2012年2月14日):久兆稳健为18,458,033.00份、久兆积极为27,687,050.00份
7、基金资产净值的披露:每个工作日的次日公布长城久兆份额净值和久兆稳健份额和久兆积极份额的参考净值,并在基金上市交易时间进行净值揭示。
8、未上市交易份额的流通规定:如有未上市交易的份额托管在场外,持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后,可选择将长城久兆份额分拆为久兆稳健和久兆积极上市流通。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)基金份额持有情况
截至2012年2月14日,本基金持有人户数为3,368户,平均每户持有的基金份额为286,800.11份;久兆稳健为1131户,平均每户持有的基金份额为16,320.09份;久兆积极为1131户,平均每户持有的基金份额为24,480.15份。
机构投资者持有的本次上市交易的久兆稳健基金份额为716,929.00份,占本次久兆稳健上市交易基金份额比例为3.88%;个人投资者持有的本次上市交易的久兆稳健基金份额为17,741,104.00份,占本次久兆稳健上市交易基金份额比例为96.12%。
机构投资者持有的本次上市交易的久兆积极基金份额为1,075,394.00份,占本次久兆积极上市交易基金份额比例为3.88%;个人投资者持有的本次上市交易的久兆积极基金份额为26,611,656.00份,占本次久兆积极上市交易基金份额比例为96.12%。
(二)基金份额前十名持有人情况:
本次上市交易的久兆稳健与久兆积极前十名持有人情况

| 序号 | 持有人名称(全称) | 持有久兆稳健份额 | 占久兆稳健份额比例 | 持有久兆积极份额 | 占久兆积极份额比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 孙起 | 400,120 | 2.17% | 600,179 | 2.17% |
| 2 | 李家红 | 400,094 | 2.17% | 600,142 | 2.17% |
| 3 | 刘颖 | 400,072 | 2.17% | 600,108 | 2.17% |
| 4 | 天津市风船化学试剂科技有限公司 | 360,064 | 1.95% | 540,096 | 1.95% |
| 5 | 北京创业工程造价估算有限公司 | 268,048 | 1.45% | 402,072 | 1.45% |
| 6 | 邵逸恺 | 240,040 | 1.30% | 360,060 | 1.30% |
| 7 | 颉清婉 | 240,040 | 1.30% | 360,060 | 1.30% |
| 8 | 赵友樵 | 200,833 | 1.09% | 301,250 | 1.09% |
| 9 | 张秀冉 | 200,052 | 1.08% | 300,079 | 1.08% |
| 10 | 蒋梅 | 200,040 | 1.08% | 300,060 | 1.08% |
| 合计 | | 2,909,403 | 15.76% | 4,364,106 | 15.76% |

## 五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、基本信息
名称:长城基金管理有限公司
法定代表人:杨光裕
总经理:熊科金
设立日期:2001年12月27日
注册资本:1.5亿元人民币
注册地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
设立批准文号:中国证监会证监基金字[2001]55号
工商登记注册的法人营业执照文号:440301103003972
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务
存续期间:持续经营
股东及其出资比例:

| 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% |

信息披露负责人:车君
电话:0755-23982338
传真:0755-23982328
2、经营概况
长城基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2001]55号文件批准,于2001年12月27日成立,注册资本为1.5亿元人民币。
截至2012年2月14日,本基金管理人共管理十三只开放式基金、一只封闭式基金及多个特定客户资产管理计划。
公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设"发展战略委员会"、"资格审查与薪酬委员会"和"风险控制与审计委员会"三个专业委员会,有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况,制定相应的政策,并充分发挥独立董事的职能,切实加强对公司运作的监督。
公司监事会由6位监事组成,主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。
公司具体经营管理由总经理负责,公司根据经营运作需要设置基金管理部、专户投资管理部、研究部、市场开发部、北京分公司、上海分公司、深圳分公司、郑州管理部、广州管理部、机构业务部、运行保障部、信息技术部、监察稽核部、综合管理部等14个职能部门及分支机构。此外,公司还设有公募基金投资决策委员会、专户投资决策委员会,确定公司投资战略和投资方向,制订重大投资决策。
各部门主要职能如下:
基金管理部:制订基金的总体投资策略,拟定基金投资的资产分布、行业和板块分布,制订基金资产配置提案和投资组合方案。
专户投资管理部:负责特定客户资产的投资管理业务、投资顾问业务及其它非公募基金的投资管理业务。
研究部:负责宏观、策略、行业和公司研究。
市场开发部:负责产品设计、管理,营销策划、媒体维护、市场推广、销售渠道管理、客户服务等工作。
北京分公司:负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。
上海分公司:负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。
深圳分公司:负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。
郑州管理部:负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。
广州管理部:负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。
机构业务部:负责机构客户、个人大客户和证券公司的代销业务开发,以及特定客户资产管理计划的业务开发和营销服务工作。
运行保障部:负责公司基金的集中交易、注册登记、资金清算、会计核算、估值。
信息技术部:负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。
监察稽核部:负责揭示、控制公司各项业务风险,对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核,督促公司内部管理制度的执行,处理日常法律事务、信息披露事务。
综合管理部:负责公司董事会、人力资源、财务管理、办公办文、企业文化、行政后勤等工作。
截至2011年12月31日,公司共有员工120人,其中65人具有硕士以上学历,5人具有博士以上学历。公司主要业务部门人员大部分具有基金从业资格。基金管理人无任何受处罚记录。
3、本基金基金经理
陈皖先生,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。
(二)基金托管人
1、基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
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
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
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
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:尹东
联系电话:(010)6759 5003

2、主要经营情况
中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。
截至2011年3月31日,中国建设银行资产总额113,125.16亿元,较上年末增加5,021.99亿元,增长4.65%。2011年一季度,中国建设银行实现净利润472.33亿元,较上年同期增长34.23%;年化平均资产回报率1.71%,年化加权平均净资产收益率26.19%;利息净收入716.30亿元,较上年同期增长25.27%;净利差为2.58%,净利息收益率为2.69%,分别较上年同期提高0.28和0.30个百分点;手续费及佣金净收入231.54亿元,较上年同期增长37.29%。其中,结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长,收入结构日趋合理。
中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科设有代表处,设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)39,874台,拥有员工313,867人,为客户提供全面的金融服务。
中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,2010年共获得100多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的"全球商业银行品牌十强"列第二位,在"全球银行品牌500强"列第13位,并被评为2010年中国最佳银行;在美国《福布斯》杂志公布的"Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜"列第三位,银行业第一位;被《亚洲金融》杂志评为2010年度"中国最佳银行";连续三年被香港《资本》杂志评为"中国杰出零售银行";被中国红十字会总会授予"中国红十字杰出奉献奖章"。
中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计,并已经成为常规化的内控工作手段。
(三)基金验资机构
名称:安永华明会计师事务所
注册地址:中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地址:中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
法定代表人:葛明
经办注册会计师:梁成杰、周刚
电话:010-58153000
传真:010-85188298

## 六、基金合同摘要

(一)基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务
1.基金管理人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利为:
(1)自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)发售基金份额;
(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,对基金财产、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,并依据基金销售服务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、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。
2.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》、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)依法接受基金托管人的监督;
(8)计算并公告基金资产净值、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;
(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。
3.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。
4.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。
5.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;
(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。
6.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
1. 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。
2.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。
3.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的,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。
4.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。
5.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对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,全部有效凭证所对应的久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额应占权益登记日各自基金份额的50%以上(含50%,下同);
②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备,到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。
2)通讯开会方式
在同时符合以下条件时,通讯会议方可举行:
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。
6.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,应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。
程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。
4)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提交基金份额持有人大会审议表决的提案,基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。
5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。
(2)议事程序
1)现场开会
在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项,确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,经合法执业的律师见证后形成大会决议。
大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的,其授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权代表主持;如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。
召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。
2)通讯方式开会
在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。
(3)基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。
7.决议形成的条件、表决方式、程序
(1)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所持每一基金份额享有平等的表决权。
(2)基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:
1)一般决议
一般决议须经出席会议的久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额表决权的50%以上通过方为有效,除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;
2)特别决议
特别决议须经出席会议的久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止久兆稳健份额与久兆积极份额的运作、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。
(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。
8.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。
9.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。
10. 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
1.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。
2.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。
3.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
1.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。
2.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
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,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托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
3.基金合同生效后的指数使用许可费
本基金作为指数基金,需根据与深圳证券信息有限公司签署的《指数使用许可协议》的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用许可费。指数使用许可费的计费时间从本基金基金合同生效日开始计算;基金合同生效之日所在季度的指数使用费,按实际计提金额收取,不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起,指数使用许可费收取下限为每季度5万元。
在通常情况下,指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。当本基金在某个季度的指数使用许可费不足5万元时,由于指数使用许可费收取下限的存在,本基金在该季度实际的指数使用许可费年费率将高于0.02%。指数使用许可费每日计算,逐日累计,按季支付。
指数使用许可费计算方法如下:
$H=E\times 0.02\%\div$当年天数
H 为每日应付的指数使用许可费
E 为前一日的基金资产净值
(五)基金财产的投资方向和投资限制
1.投资目标
本基金通过投资约束和数量化监控,力求实现对中小板300(价格)指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
2.投资范围
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。
3.投资限制
(1)组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:
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%;本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;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%;本基金管理人管理的全部基金持有同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。
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。
如果法律法规对本基金合同约定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。
(2)禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
1)承销证券;
2)向他人贷款或者提供担保;
3)从事承担无限责任的投资;
4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;
9)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。
(六)基金资产净值的计算方法和公告方式
1.基金资产净值
基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。
基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。
每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。
2.基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告
(1)本基金的基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和久兆300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;
(2)在久兆稳健份额、久兆积极份额上市交易或开始办理久兆300份额申购或者赎回后,基金管理人将在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计净值;
(3)基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日(或自然日)基金资产净值和久兆300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。基金管理人应当在上述市场交易日(或自然日)的次日,将基金资产净值以及久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额各自的基金份额参考净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。
(七)基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式
1.基金合同的变更
(1)基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的,应召开基金份额持有人大会,基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。
1)转换基金运作方式;
2)变更基金类别;
3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
4)变更基金份额持有人大会程序;
5)更换基金管理人、基金托管人;
6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外;
7)本基金与其他基金的合并;
8)终止久兆稳健份额与久兆积极份额的运作;
9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意变更后公布,并报中国证监会备案:
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。
(2)关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。
2.基金合同的终止
有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:
(1)基金份额持有人大会决定终止的;
(2)基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
(3)基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;
(4)中国证监会规定的其他情况。
3.基金财产的清算
(1)基金财产清算组
1)基金合同终止时,成立基金财产清算组,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。
2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。
(2)基金财产清算程序
基金合同终止,应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:
1)基金合同终止后,发布基金财产清算公告;
2)基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;
3)对基金财产进行清理和确认;
4)对基金财产进行估价和变现;
5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
6)聘请律师事务所出具法律意见书;
7)将基金财产清算结果报告中国证监会;
8)参加与基金财产有关的民事诉讼;
9)公布基金财产清算结果;
10)对基金剩余财产进行分配。
(3)清算费用
清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。
(4)基金财产按下列顺序清偿:
1)支付清算费用;
2)交纳所欠税款;
3)清偿基金债务;
4)根据基金合同终止日久兆300份额的基金份额净值、久兆稳健份额与久兆积极份额各自参考净值分别计算久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额三类份额各自的应计分配比例,在此基础上,在久兆300份额、久兆稳健份额与久兆积极份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。
基金财产未按前款1)-3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。
经基金份额持有人大会决议通过,并经中国证监会核准,在本基金的久兆稳健份额与久兆积极份额终止运作后,如果本基金进行基金财产清算,则依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
(5)基金财产清算的公告
基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。
(6)基金财产清算账册及文件的保存
基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。
(八)争议解决方式
对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,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,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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。
争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。
本基金合同受中国法律管辖。
(九)基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式
本基金合同可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅,但其效力应以基金合同正本为准。

## 七、基金财务状况

本基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产中支付。深圳证券交易所在长城久兆中小板300指数分级证券投资基金募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。
本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
长城久兆中小板300指数分级证券投资基金2012年2月14日资产负债表(未经审计)如下:

| 日期:2012年2月14日 | | | |
|---|---|---|---|
| 资产 | 期末余额 | 负债和所有者权益 | 期末余额 |
| 资 产: | | 负债: | |
| 银行存款 | 6,540,417.53 | 短期借款 | - |
| 结算备付金 | 6,356,666.67 | 交易性金融负债 | - |
| 存出保证金 | - | 衍生金融负债 | - |
| 交易性金融资产 | - | 卖出回购金融资产款 | - |
| 其中:股票投资 | - | 应付证券清算款 | 885,132.61 |
| 债券投资 | - | 应付赎回款 | - |
| 资产支持证券投资 | - | 应付管理人报酬 | 369,664.62 |
| 基金投资 | - | 应付托管费 | 81,326.22 |
| 衍生金融资产 | - | 应付销售服务费 | - |
| 买入返售金融资产 | 955,000,000.00 | 应付交易费用 | - |
| 应收证券清算款 | - | 应付税费 | - |
| 应收利息 | 380,198.70 | 应付利息 | - |
| 应收股利 | - | 应付利润 | - |
| 应收申购款 | - | 其他负债 | 25,962.59 |
| 其他资产 | - | 负债合计 | 1,362,086.04 |
| | | 所有者权益: | |
| | | 实收基金 | 965,942,785.13 |
| | | 未分配利润 | 972,411.73 |
| | | 所有者权益合计 | 966,915,196.86 |
| 资产合计: | 968,277,282.90 | 负债与持有人权益总计: | 968,277,282.90 |

## 八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2012年2月14日,长城久兆中小板300指数分级证券投资基金的投资组合如下:
本投资组合报告所载数据截至2012年2月14日,本报告中财务资料未经审计。
1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 955,000,000.00 | 98.63 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 12,897,084.20 | 1.33 |
| 6 | 其他资产 | 380,198.70 | 0.04 |
| 7 | 合计 | 968,277,282.90 | 100.00 |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有股票。
3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有股票。
4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。
5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
注:本基金本报告期末未持有债券。
6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
8、投资组合报告附注
(1)本基金本报告期末投资股票,不存在投资的前十名证券的发行主体在本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
(2)本基金本报告期末投资股票,不存在投资的前十名股票中有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
(3)其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 380,198.70 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 380,198.70 |

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末投资股票,本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。
(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 九、重大事件揭示

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同已于2012年1月30日正式生效,基金管理人已于2012年1月31日在《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》刊登《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同生效公告》。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

.基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,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。
(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。
(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,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。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

## 十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅;也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件,但应以基金合同正本为准。
(一)中国证监会核准长城久兆中小板300指数分级证券投资基金募集的文件;
(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招募说明书》;
(四)《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金托管协议》;
(五)关于长城基金管理有限公司募集设立长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之法律意见书;
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照;
(八)中国证监会要求的其他文件。

**长城基金管理有限公司**
**2012年2月16日**