

# 关于以通讯方式召开长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

2018-12-18

长城基金管理有限公司已于 2018 年 12 月 17 日在《中国证券报》及长城基金管理有限公司网站（www.ccfund.com.cn）发布了《关于以通讯方式召开长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开本次会议的第一次提示性公告。

## 一、召开会议基本情况

为了更好地满足广大投资者的需求，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人长城基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型方案等相关事宜，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自 2018 年 12 月 18 日起至 2019 年 1 月 16 日 17:00 止（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）基金份额持有人或其代理人可通过专人送交、邮寄送达至以下地址的下述收件人。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

公证机关：深圳市深圳公证处

收件人：丁青松、卢润川

联系地址：深圳市福田区深南大道 4013 号兴业银行大厦 17 楼 1706/1708

联系电话：0755-83024185/0755-83024187

邮政编码：518048

请在信封表面注明：“长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-8868-666 咨询。

## 二、会议审议事项

《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》（附件一）。

上述议案的说明及基金合同的详细修订内容详见《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》（附件四）。

## 三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2018 年 12 月 18 日，即在 2018 年 12 月 18 日下午交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

## 四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录本基金管理人网站（[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，该合格境外机构

投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

(4) 个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(5) 机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(6) 合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

(7) 以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的授权委托书等相关文件在前述会议投票表决起止时间内（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址的下述收件人：

公证机关：深圳市深圳公证处

收件人：丁青松、卢润川

联系地址：深圳市福田区深南大道 4013 号兴业银行大厦 17 楼 1706/1708

联系电话：0755-83024185/0755-83024187

邮政编码：518048

请在信封表面注明：“长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-8868-666 咨询。

## 五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国工商银行股份有限公司）授权代表的监督下于 2019 年 1 月 17 日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金托管人经通知但拒绝到场监督，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额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。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，其所代表的基金份额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。

(3) 表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不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。

(4) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1) 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2) 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决票，但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；

3) 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准。

## 六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的 1/2 以上（含 1/2）；

2、《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》应当由前述参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

## 七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会需要有效表决票所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 1/2 以上（含 1/2）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《基金法》，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有

人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

## 八、本次大会相关机构

1、召集人：长城基金管理有限公司

联系地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40 层

联系电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网址：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)

2、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

3、公证机关：深圳市深圳公证处

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系电话：021-31358666

## 九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会相关公告可通过基金管理人网站（[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)）查阅，投资者如有任何疑问，可致电本公司客户服务电话 400-8868-666 咨询。

3、本公告的有关内容由长城基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》

长城基金管理有限公司

2018年12月18日

附件一：

#### 关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人：

为了更好地满足广大投资者的需求，提高产品的市场竞争力，长城基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规和《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，现提议对《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》按照《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》（见附件四）的内容进行修改，并相应修改《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》相关内容。

以上议案，请予审议。

长城基金管理有限公司

2018年12月17日

附件二：

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名或名称：

证件号码（身份证件号/营业执照号）：

基金账号：

审议事项	同意	反对	弃权
关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转 型有关事项的议案			

基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章

年 月 日

说明：



若长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金在规定时间内重新召开审议相同议案的份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号或营业执照注册号）：

委托人基金账户号：

受托人（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号或营业执照注册号）：

委托日期：                    年            月            日

附注：

- 1、以上授权是基金份额持有人就其持有的长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金全部份额向受托人所做授权。
- 2、本授权委托书中“证件号码”，指基金份额持有人认购、申购本基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。
- 3、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

## 长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书

### 一、声明

1、为了更好地满足广大投资者的需求，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法律法规和《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）的有关规定，本基金管理人（长城基金管理有限公司）经与基金托管人（中国工商银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。

2、本次长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“长城创新动力”）转型方案须由持有有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2）的持有人出席方可召开，且《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》须经参加本次持有人大会表决的基金份额持有人（或代理人）所持表决权的 2/3（含 2/3）以上通过，存在未能达到开会条件或无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的决议需依法报中国证监会备案，自表决通过之日起生效。中国证监会对本次长城创新动力转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

### 二、长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金变更注册主要内容

#### （一）变更基金名称

基金名称由“长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金”变更为“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”，并在基金合同中增加与发起式基金相关的内容。

## （二）变更基金的类别

基金类别由“混合型证券投资基金”变更为“股票型证券投资基金”。

## （三）增加 C 类基金份额。

## （四）变更基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

原文：

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

拟修改为：

《基金合同》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于 2 亿元，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

《基金合同》生效三年后继续存续的，自基金合同生效满三年后的基金存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## （五）变更投资目标、投资范围、投资策略和风险收益特征

变更了基金的投资目标、投资范围、投资策略和风险收益特征，对基金合同的相应内容修改如下：

### （1）变更投资目标

原文：

本基金重点投资于经济发展过程中具备持续增长潜力，能够代表经济发展方向的行业龙头公司，追求基金资产的长期稳健增值。

拟修改为：

以增强指数化投资方法跟踪目标指数，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。

## （2）变更投资范围

原文：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债纯债、资产支持证券等）、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%，其中，投资于创新动力主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

拟修改为：

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### (3) 变更投资策略

原文：

#### 1、大类资产配置策略

本基金为灵活配置混合型证券投资基金，将依据市场情况灵活进行基金的大类资产配置。

本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素，在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素，如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等；对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况，对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上，本基金将参考基金流动性要求，以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。

## 2、股票投资策略

### (1) 创新动力主题的定义

本基金创新动力主题包括新兴产业的创新和传统产业的升级两个方面。

#### 1) 新兴产业的创新主要包括新产业、新科技和新的商业模式。

**新产业：**根据《国务院关于加快培育和发展战略性新兴产业的决定》中的规定，当前战略新兴产业包括但不限于电子元器件、计算机、传媒、通信、节能环保、生物医药、生物育种、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车等。同时，新产业并不是永恒不变的，在不同的经济发展时期，新产业的产业构成会发生很大的变化。

**新科技：**主要包括但不限于现代农业、装备制造、生态环保、能源资源、信息网络、新型材料、公共安全和健康等。

**新的商业模式：**指在业态发展进程中，以新的经营方式、新的经营技术、新的经营手段取代传统的经营方式和技术手段。新的商业模式的应用和推广，主要包括但不限于电子商务、现代物流、医疗卫生、信息服务业等。

#### 2) 传统产业的升级主要包括三个层面

一是通过对传统行业进行技术改造、组织架构和治理结构调整、资产梳理与整合而实现更高效、更环保、更集约、更有竞争力的生产与经营；

二是通过创新，尤其是信息技术的应用，使得在传统行业中产生新的业态；

三是传统行业主动寻求变革，向新兴行业转型。

### (2) 个股投资策略

本基金将依据创新动力投资主题的定义确定备选股票池，并依据定性分析和定量分析相结合的方法，进行综合评估筛选，构建本基金的各级股票池。

#### 1) 定性分析

本基金通过传统的定性分析手段，关注上市公司的主营业务可持续发展能力、竞争优势、管理能力三个方面：

**主营业务可持续发展能力：**主要考察上市公司在细分行业中所处的竞争地位、产品定价能力，是否具有相对成本优势、从事主营业务的历史，以及主营业务在市场不同经济周期中的发展状况。

**竞争优势：**主要考察上市公司在商业模式、科技创新能力、品牌、经营效率等方面是否具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的相对优势。

**管理能力：**主要考察上市公司经营独立性、管理层对股东的责任感、管理层长效约束与激励机制的建立、管理层长远眼光和战略能力，以及能够对外部环境变化迅速作出反应。

## 2) 定量分析

在定量分析中，本基金将结合 PE、PB、PS、PEG 等相对估值指标以及自由现金流贴现等绝对估值方法来考察企业的估值水平，以判断当前股价高估或低估。创新动力投资主题的股票因其高成长性一般估值较高，因此，本基金在关注估值指标的同时，还会关注营业收入增长率、盈利增长率、现金流量增长率、及净资产收益率等指标，来评估企业的成长性。在考察其科技创新能力可持续性方面，将重点关注研发费用与营业收入的占比，及获得财政补贴的情况。而在业务结构分布上，通过其收入的地区占比及业务占比，并结合对于不同地区不同业务的发展空间研判，来综合评估。本基金将通过对行业估值指标的横向、纵向分析，并结合成长性的行业比较，并结合其他量化指标，综合选择估值与成长位于合理区间的创新动力投资主题的企业进行投资，动态构建资产组合。同时，本基金在进行股票资产配置时，将考察企业的流动性和换手率指标，参考基金的流动性需求，以降低股票资产的流动性风险。

## 3、债券投资策略

当股票市场投资风险和不确定性增大时，本基金将择机把部分资产转换为债券资产，或通过参与一级债券市场交易获取低风险收益，以此降低基金组合资产风险水平。本投资组合对于债券的投

资以久期管理策略为基础，在此基础上结合收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略对债券资产进行动态调整，并择机把握市场低效或失效情况下的交易机会。

#### 4、中小企业私募债券投资策略

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

本基金投资于单只中小企业私募债的比例不得超过本基金资产净值的 10%。未来法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制。

在中小企业私募债选择时，本基金将采用公司内部债券信用评级系统对信用评级进行持续跟踪，防范信用风险。在此基础上，本基金重点关注中小企业私募债的发行要素、担保机构等发行信息对债项进行增信。

本基金将根据相关法律法规要求披露中小企业私募债的投资情况。

#### 5、权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

#### 6、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、标的资产的构成、质量及提前偿还率等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

拟修改为：

#### 1、资产配置策略

本基金为增强型指数基金，股票投资以创业板指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。

## 2、股票组合构建

对指数投资部分，结合指数的特点，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素，运用成熟的量化技术模型，采用抽样复制的方法，在创业板综指成份股内从长期和短期两个维度动态刻画指数风格特征，构建风格中性和行业中性的投资组合，从而实现指数的紧密跟踪。但是当以下情况发生时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以实现本基金对业绩比较基准的紧密跟踪：(1)基金管理人预期指数成份股或权重发生变化；(2)由于市场因素影响、法律法规限制等原因，本基金无法根据指数构建组合；(3)基金发生申购赎回、成份股派发现金股息等可能影响跟踪效果的情形。

对主动投资部分，本基金基于基金管理人量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子股票模型进行投资。多因子模型基于A股上市公司的历史数据，借助数量化的技术手段，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子，通过回测研究各个因子的历史表现，寻找收益稳定、互补性强的因子对股票进行综合评分，根据评分结果精选各个行业的优质股票构成组合。

多因子模型的因子来源主要包括基本面因子、市场交易型因子、预期性因子等。财务因子是考察根据上市公司的财务数据和市值等基本信息，包括但不限于市盈率、市净率、市销率、净利润复合增长率、营业收入复合增长率、净资产收益率、杠杆率等；市场交易型因子主要是分析二级市场行情交易中的数据，包括但不限于换手率、波动率、贝塔、流动性指标等；预期型因子主要是根据个股的分析师评级等市场情绪和预测指标构建，是反映了机构投资者对于上市公司未来盈利状况和股价走势的一致性意见。

多因子模型在组合层面上，根据基准指数的特点严格控制行业偏离以及个股偏离，并在综合考虑预期风险和收益水平基础上进行组合权重优化，力争有效跟踪基准指数的同时获取超额收益。

### 3、股票组合调整

在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人将对投资组合进行调整，以降低跟踪误差，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

(1) 指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响，适时进行投资组合调整。

(2) 指数成份股定期或临时调整。基金管理人将预测指数成份股调整方案，并判断指数成份股调整对投资组合的影响，在此基础上确定组合调整策略。

(3) 指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响，并据此确定相应的投资组合调整策略。

(4) 基金发生申购赎回、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响，据此对投资组合进行相应调整。

(5) 法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据指数建立组合。基金管理人将根据市场情况，以跟踪误差最小化为原则对投资组合进行调整。

(6) 根据主动增强策略，对增强部分头寸进行主动性的调整，在控制跟踪误差原则下，增强组合收益

### 4、债券投资策略

本基金将根据“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，重点参考基金的流动性管理需要，选取流动性较好的债券进行配置。

### 5、权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

### 6、资产支持证券投资策略

本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 7、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息，分析企业的长期运作风险；②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价，评估发行人财务风险；③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率；④考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；⑤综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。

#### 8、股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

##### 多头套期保值策略

本基金为指数增强基金，当指数期货大幅贴水时，可采用多头套期保值策略，即卖出部分股票持仓并买入指数期货的期货替代现货策略。持有至基差收敛，赚取期货与现货指数的价差，增强指数。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 9、其他

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

### （4）变更业绩比较基准

原文：

本基金的业绩比较基准为： $50\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 50\% \times \text{中债综合财富指数收益率}$ 。

拟修改为：

本基金的业绩比较基准为： $\text{创业板指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率(税后)} \times 5\%$ 。

### （5）变更风险收益特征

原文：

本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于中等风险、中等收益的基金产品。

拟修改为：

本基金为股票型基金，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。

### （六）调整基金的估值对象和估值方法

### （七）调整基金的费率

#### 1、调整基金管理费率和基金托管费率

原费率结构：

管理费：1.50%/年

托管费：0.25%/年

拟修改为：

管理费：1.00%/年

托管费：0.15%/年

2、补充 C 类基金份额的销售服务费、指数许可使用基点费

C 类基金份额的销售服务费年费：0.3%/年

指数许可使用基点费：0.02%/年

指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 8000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

3、调整赎回费率

原赎回费率结构：

持续持有期（天）	赎回费率
期限<7 日	1.50%
7 日<=期限<29 日	0.75%
30 日<=期限<184 日	0.50%
185 日<=期限<365 日	0.25%
366 日<=期限	0.00%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 天的基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 天(含)但少于 92 天的基金份额所收取的赎回费的 75%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于 92 天(含)但少于 185 天的基金份额所收取的赎回费的 50%计

入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于 185 天(含)的份额所收取的赎回费的 25%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

拟修改为：

本基金的赎回费率随基金份额持有时间的增加而递减，本基金对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别采用不同的赎回费率结构，具体费率如下表所示：

(1) A 类基金份额赎回费率：

持续持有期 (T)	赎回费率
T<7 天	1.5%
7 天≤T<365 天	0.5%
T≥365 天	0

(2) C 类基金份额赎回费率：

持续持有期 (T)	赎回费率
T<7 天	1.5%
T≥7 天	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 天的基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 天(含)但少于 92 天的基金份额所收取的赎回费的 75%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于 92 天(含)但少于 185 天的基金份额所收取的赎回费的 50%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于 185 天(含)的份额所收取的赎回费的 25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

(八) 调整收益分配方式

调整了基金的收益分配方式，对基金合同的相应内容修改如下：

原文：

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

拟修改为：

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致，并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

（九）其他与上述修改相关、因完善基金实际运作而作出的必要修改。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照现时有效的法律法规的规定、根据基金份额持有人大会决议修订基金合同的内容。修订后的基金合同需经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或授权代表签章，并已经中国证监会变更注册。

（十）本基金新修改的基金合同的生效

基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效，新修改的基金合同具体生效日期本基金管理人将另行公告。自新修改的基金合同生效日起，《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时失效，长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金正式变更为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金，本基金的基金合同当事人将按照《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

### **三、基金管理人就转型方案相关事项的说明**

（一）长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金的历史沿革

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金经 2015 年 9 月 1 日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]2048 号文注册募集。基金管理人为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 1 日生效。

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金将以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，若该议案获得基金份额持有人大会通过，则基金管理人将根据基金份额持有人大会的授权，对长城创新动力灵活配置混合型

证券投资基金实施转型，包括调整基金的类别、投资范围、投资策略、收益分配、方式、基金的估值以及基金费用等，基金名称相应变更为“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”，长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额将转换为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金份额。

## （二）基金转型有利于保护份额持有人利益

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型方案是在与相关各方进行广泛沟通的基础上制定出的切实可行的方案。

## （三）基金转型的可行性

1、基金管理人具有丰富的基金转型运作经验，基金管理人已成功操作过基金久富转型为长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）、基金久嘉转型为长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金的封闭式基金封转开的工作，在基金转型上积累了较为丰富的经验。

### 2、基金转型不存在法律障碍

依据《基金法》和《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本次变更注册须经提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。按照基金份额持有人大会的决议，并经中国证监会备案，基金可以转型。因此，长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金不存在法律障碍。

### 3、基金转型不存在技术障碍

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金，在技术准备方面，对基金所涉及的业务功能进行了技术系统的完善工作，并已完成了必要的系统测试工作。因此，基金转型不存在技术障碍。

### 4、调整投资目标、投资范围和投资策略的可行性

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型之后，必须对原有基金合同中的有关内容进行修订，使其在投资目标、投资范围及其投资组合比例限制、投资策略等方面符合法律法规的规定。

#### 5、授权基金管理人修订基金合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同。修订后的基金合同已经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或授权代表签章，并已经中国证监会变更注册。

### 四、基金转型的主要风险及预备措施

#### （一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，本次份额持有人大会需要本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额的 1/2 以上（含 1/2）方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

#### （二）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

#### （三）基金转型后遭遇大规模赎回的风险

为降低部分基金份额持有人在基金转型后大量赎回对基金平稳运作的影响，本基金在转型期间将保证投资组合的流动性，以应对转型前后可能出现的较大赎回，降低净值波动率。

基金转型方案公告后，若出现基金净值剧烈波动等极端情况，基金管理人承诺将根据实际情况，加快转型进程，更早开放基金的日常赎回业务。

## 五、基金合同修改内容汇总

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同的修改请参见本基金管理人网站

([www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)) 公布的《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同修订对照表》。