

# 关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金实施转型的提示性

## 公告

建信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）于 2020 年 3 月 21 日起，至 2020 年 3 月 30 日 17:00 止以通信方式组织召开了建信双利策略主题分级股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会，审议了《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》（以下简称“议案”），并于 2020 年 3 月 31 日表决通过了《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》，本次会议的决议自表决通过之日起生效。

根据本次基金份额持有人大会通过的议案及相关议案说明，现将本基金实施转型的相关事宜具体安排如下：

### 一、转型选择期

本次基金份额持有人大会决议生效后，建信双利策略主题分级股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）将安排不少于 20 个交易日的选择期，以供基金份额持有人做出选择。具体转型选择期期间为 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 4 月 30 日。选择期期间，建信双利基金份额的申购、赎回、日常转换业务，以及建信稳健份额、建信进取份额的交易、配对转换业务照常办理。原基金份额持有人可以选择卖出建信稳健份额、建信进取份额或者赎回建信双利基金份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额将在份额转换基准日进行转换，最终转换为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额。

由于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、日常转换、配对转换或调整申购、赎回、日常转换的方式及限额等。

### 二、本基金建信稳健份额、建信进取份额的终止上市交易

2

基金管理人将按照深圳证券交易所、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请建信稳健份额与建信进取份额的终止上市。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

### 三、基金份额的折算与转换

转型选择期届满的次一工作日为份额转换基准日（2020 年 5 月 6 日）。基金管理人在份额转换基准日将建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额转换成建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）的 A 类基金份额。

本次基金份额转换主要分为以下两个步骤进行：

#### 1、 将建信稳健份额与建信进取份额转换成建信双利基金份额的场内份额

在份额转换基准日，以建信双利基金份额的基金份额净值为基准，建信稳健份额、建信进取份额按照各自的基金份额参考净值转换成建信双利基金份额的场内份额。建信稳健份额（或建信进取份额）基金份额持有人持有的转换后建信双利基金份额的场内份额数取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金

资产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临基金资产净值减小的风险，对于持有份额数较少的建信稳健份额、建信进取份额持有人，将面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金财产的风险。

份额转换计算公式如下：

建信稳健（或建信进取）的转换比例=份额转换基准日建信稳健（或建信进取）的基金份额参考净值/份额转换基准日建信双利基金份额的基金份额净值  
建信稳健（或建信进取）基金份额持有人持有的转换后建信双利基金份额的场内份额=基金份额持有人持有的转换前建信稳健（或建信进取）的份额数×建信稳健（或建信进取）的转换比例

## 2、将建信双利基金份额转换成建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）的 A 类基金份额

在建信稳健份额与建信进取份额转换为建信双利基金份额的场内份额后，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将建信双利基金份额的场内份额和场外份额分别转换为份额净值为 1.0000 元的建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的场内份额和场外份额。基金份额转换后，场外的建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的份额数保留到小数点后

3 位，小数点后第 3 位截位，由此产生的计算误差归入基金资产。场内的建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金资产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临基金资产净值减小的风险，对于持有份额数较少的建信双利基金份额持有人，将面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换计算公式如下：

转换后建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的份额数=建信双利基金份额数×份额转换基准日建信双利基金份额的基金份额净值/1.0000

转换后建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的份额净值为 1.0000 元。

四、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的生效  
自份额转换基准日次日起，基金名称将由“建信双利策略主题分级股票型证券投资基金”更名为“建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）”。《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》同日失效。

建信基金管理有限责任公司

2020 年 4 月 1 日