

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金办理定期份额折算 业务的公告

根据《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”），及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，建信双利策略主题分级股票型证券投资基金（简称“本基金”）将在 2012 年 1 月 4 日办理首次定期份额折算业务。相关事项提示如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为 2012 年 1 月 4 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的建信稳健份额、建信双利基金份额。

三、基金份额折算方式

建信稳健份额和建信进取份额按照《基金合同》规定的净值计算规则进行净值计算，对建信稳健份额的应得收益进行定期份额折算，每 10 份建信双利基金份额将按 4 份建信稳健份额获得约定应得收益的新增折算份额。

对于建信稳健份额期末的约定应得收益，即建信稳健份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出本金 1.000 元部分，将折算为场内建信双利基金份额分配给建信稳健份额持有人。建信双利基金份额持有人持有的每 10 份建信双利基金份额将按 4 份建信稳健份额获得新增建信双利基金份额的分配。持有场外建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外建信双利基金份额的分配；持有场内建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内建信双利基金份额的分配。经过上述份额折算，建信稳健份额和建信双利基金份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日,本基金将对建信稳健份额和建信双利基金份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行建信稳健份额上一年度应得收益的定期份额折算时,有关计算公式如下:

(1) 建信稳健份额

$$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} = NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$$

$$NAV_{\text{稳健}}^{\text{后}} = 1.000\text{元}$$

$$NAV_{\text{双利}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前建信双利基金份额的资产净值} - (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000) \times 4/10 \times NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}$$

$$\text{建信稳健份额持有人新增的场内建信双利份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}}$$

其中:

$NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}}$: 定期份额折算前建信稳健份额的份额净值

$NAV_{\text{稳健}}^{\text{后}}$: 定期份额折算后建信稳健份额的份额净值

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$: 定期份额折算前建信稳健份额的份额数

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}}$: 定期份额折算后建信稳健份额的份额数

$NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}$: 定期份额折算后建信双利基金份额的份额净值

$NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}$: 定期份额折算前建信双利基金份额的份额数

建信稳健份额新增份额折算成建信双利基金份额的场内份额取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

(2) 建信进取份额

每个会计年度的定期份额折算不改变建信进取份额净值及其份额数。

(3) 建信双利基金份额

$$NAV_{\text{后双利}} = \frac{\text{折算前建信双利基金份额的资产净值} - (NAV_{\text{前稳健}} - 1.000) \times 4/10 \times NUM_{\text{前双利}}}{NUM_{\text{前双利}}}$$

$$\text{建信双利基金份额持有人新增的建信双利基金份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{前双利}} \times 4}{10} \times \frac{NAV_{\text{前稳健}} - 1.000}{NAV_{\text{后双利}}}$$

定期份额折算后建信双利基金份额的份额数 = 定期份额折算前建信双利基金份额的份额数 + 建信双利基金份额持有人新增的建信双利基金份额的份额数

其中：

$NAV_{\text{前稳健}}$ ：定期份额折算前建信稳健份额的份额净值

$NAV_{\text{后双利}}$ ：定期份额折算后建信双利基金份额的份额净值

$NUM_{\text{前双利}}$ ：定期份额折算前建信双利基金份额的份额数

建信双利基金份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；建信双利基金份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

（4）举例

假设 2012 年 1 月 4 日为定期份额折算基准日，建信双利基金份额当天折算前资产净值为 7,458,000,000 元。当天场外建信双利基金份额、场内建信双利基金份额、建信稳健份额、建信进取份额的份额数分别为 50 亿份、5 亿份、40 亿份、60 亿份。前一个会计年度末每份建信稳健份额资产净值（建信稳健份额的份额净值）为 1.065000000 元，且未进行不定期份额折算。

A、定期份额折算的对象为基准日登记在册的建信稳健份额和建信双利基金份额，即 40 亿份和 55 亿份。

B、建信稳健份额持有人

折算后持有建信稳健份额=折算前建信稳健份额=40 亿份

$$NAV_{\text{双利}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前建信双利基金份额的资产净值} - (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000) \times 4/10 \times NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}$$

$$= \frac{7,458,000,000 - (1.065000000 - 1.000) \times 4/10 \times 5,500,000,000}{5,500,000,000} = 1.330 \text{元}$$

$$\text{建信稳健份额持有人新增的场内建信双利基金份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}}$$

$$= \frac{4,000,000,000 \times (1.065000000 - 1.000)}{1.330} = 195,488,721.80 \text{份}$$

建信稳健份额新增份额折算成建信双利基金份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产，因此新增建信双利基金份额为 195,488,721 份；持有的建信稳健份额为 40 亿份。

C、建信进取份额持有人

本次份额折算不改变建信进取份额净值及其份额数。

D、建信双利基金份额持有人

$$\text{场外新增的建信双利基金份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}} \times 4}{10} \times \frac{NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}}$$

$$= \frac{5,000,000,000 \times 4}{10} \times \frac{1.065000000 - 1.000}{1.330} = 97,744,360.90 \text{份}$$

定期份额折算后场外建信双利基金份额的份额数=定期份额折算前场外建信双利基金份额的份额数+场外新增的建信双利基金份额
 =5,000,000,000+97,744,360.90=5,097,744,360.90 份

$$\text{场内新增的建信双利基金份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}} \times 4}{10} \times \frac{NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}}$$

$$= \frac{500,000,000 \times 4}{10} \times \frac{1.065000000 - 1.000}{1.330} = 9,774,436.09 \text{份}$$

取整后为 9,774,436 份，定期份额折算后场内建信双利基金份额的份额数=定期份额折算前场内建信双利基金份额的份额数+场内新增的建信双利基金份额=500,000,000+9,774,436 =509,774,436 份

四、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 定期份额折算基准日(即 2012 年 1 月 4 日)，本基金暂停办理申购、赎回、转托管(包括场外转托管、跨系统转托管，下同)业务；配对转换业务及建信稳健、建信进取交易正常。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

(二) 定期份额折算基准日后的第一个工作日(即 2012 年 1 月 5 日)，本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，建信稳健暂停交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

(三) 定期份额折算基准日后的第二个工作日(即 2012 年 1 月 6 日)，基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，建信稳健恢复交易。

(四) 根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后复牌首日前收盘价调整的通知》，2012 年 1 月 6 日建信稳健复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2012 年 1 月 5 日的建信稳健份额净值。由于建信稳健折算前可能存在折溢价交易情形，且建信稳健份额折算后恢复交易首日的收盘价以前一日的建信稳健的基金份额净值确定，因此，建信稳健份额折算后恢复交易首日的收盘价与份额折算前的收盘价格可能发生较大变化。

五、重要提示

由于建信稳健份额新增份额折算成建信双利基金份额的场内份额数和建信双利基金份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份)，舍去部分计入基金财产，持有较少建信稳健份额数或场内建信双利基金份额数的份额持有人存在无法获得新增场内建信双利基金份额的可能性。因此，上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.ccbfund.cn 或者拨打本公司客服电话：400-81-95533（免长途通话费）、010-66228000。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司

二〇一一年十二月二十九日