
建信双利策略主题分级股票型
证券投资基金
基金合同

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

目 录

一、前 言	3
二、释义	5
三、基金的基本情况	11
四、基金份额分级	12
五、基金份额的发售	15
六、基金备案	17
七、建信稳健、建信进取的上市与交易	18
八、基金份额的申购与赎回	20
九、场内份额配对转换	30
十、基金合同当事人及权利义务	32
十一、基金份额持有人大会	39
十二、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	47
十三、基金的托管	50
十四、基金份额的注册登记	51
十五、基金的投资	52
十六、基金的财产	62
十七、基金资产的估值	63
十八、基金的费用与税收	69
十九、基金的收益与分配	71
二十、基金份额的折算	72
二十一、基金的会计和审计	81
二十二、基金的信息披露	82
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	88
二十四、违约责任	91
二十五、争议的处理	92
二十六、基金合同的效力	93
二十七、其他事项	94

一、前 言

（一） 订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称《合同法》）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

（二） 基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

（三） 建信双利策略主题分级股票型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者投资于本基金，必须自担风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

（四） 基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以

基金合同为准。

《基金合同》应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致《基金合同》的内容与届时有效的法律法规的规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应的变更和调整，同时就该等变更或调整进行公告。

二、释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指建信双利策略主题分级股票型证券投资基金
- 2、基金管理人：指建信基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人：指招商银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同

年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者：符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指直销机构和代销机构

24、直销机构：指建信基金管理有限责任公司

25、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

26、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

27、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

28、注册登记机构：建信基金管理有限责任公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

29、注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

30、证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司证券登记结算系统

31、基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

32、交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

33、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

34、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

35、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、基金份额结构：本基金的基金份额包括三种：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额（简称“建信双利基金份额”）、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额（简称“建信稳健份额”）与建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额（简称“建信进取份额”）。其中，建信稳健份额、建信进取份额的基金份额配比始终保持4:6的比例不变

38、建信双利基金份额：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额

39、建信稳健份额：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健

收益类份额

40、建信进取份额：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额

41、场内份额的分拆：指场内持有人所持有的建信双利基金份额按照4:6的比例分拆成预期收益与风险不同的两类基金份额，即建信稳健份额与建信进取份额的行为

42、场内份额的合并：指场内持有人所持有的建信稳健份额与建信进取份额按照4:6的比例合并成建信双利基金份额的行为

43、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

44、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

45、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

46、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

47、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

48、发售：在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为

49、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

50、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买建信双利基金份额的行为

51、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将建信双利基金份额兑换为现金的行为

52、上市交易：指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖建信稳健份额与建信进取份额的行为

53、场外：通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、建信双利基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、建信双利基金份额申购和赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

54、场内：指通过深圳证券交易所交易系统内的会员单位进行基金份额认购、建信双利基金份额申购和赎回以及建信稳健份额与建信进取份额上市

交易的场所

55、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的、已开通基金转换业务的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为

56、转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的建信双利基金份额从一个交易帐户托管转移到另一交易帐户的行为

57、系统内转托管：投资者将其持有的建信双利基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为

58、跨系统转托管：投资者将其持有的建信双利基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为

59、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

60、巨额赎回：指本基金单个开放日，建信双利基金份额的净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额）的10%

61、元：指人民币元

62、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

63、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

64、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

65、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

66、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资

产净值的过程

67、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

68、不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易、公众通讯设备或互联网络故障

69、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

三、基金的基本情况

（一）基金的名称

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

（二）基金的类别

股票型

（三）基金的运作方式

契约型开放式

（四）场内份额配对转换

基金管理人建信双利基金份额开放申购、赎回，但不对建信稳健份额与建信进取份额单独开放申购、赎回业务。场内建信双利基金份额可按照 4:6 的比例分拆成预期收益与风险不同的两类基金份额，即建信稳健份额与建信进取份额，而建信稳健份额与建信进取份额也可按照 4:6 的比例合并成建信双利基金份额。场外的基金份额不进行份额配对转换业务。

（五）基金的投资目标

本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

（六）基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

（七）基金份额面值 and 认购费用

本基金基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。

本基金认购费率最高不超过 5%，具体费率按招募说明书的规定执行。

（八）基金存续期限

基金存续期限为不定期。

四、基金份额分级

（一）基金份额结构

本基金的基金份额包括三种：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额（简称“建信双利基金份额”）、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额（简称“建信稳健份额”）与建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额（简称“建信进取份额”）。其中，建信稳健份额、建信进取份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。

（二）基金的基本运作概要

1、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建信双利基金份额；场内认购的全部份额将按 4:6 的比率确认为建信稳健份额与建信进取份额；

2、本基金合同生效后，建信双利基金份额只接受场外与场内申购和赎回，不上市交易；

3、投资者可选择将其登记在场内的建信双利基金份额按 4:6 的比例分拆成建信稳健份额和建信进取份额；

4、建信稳健份额、建信进取份额只上市交易，不接受申购和赎回；

5、本基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理建信双利基金份额与建信稳健份额、建信进取份额之间的份额配对转换业务；

6、本基金合同生效后，基金管理人按照基金合同的约定在基金份额折算日对本基金进行折算。折算后基金运作方式及建信稳健与建信进取份额配比不变。

（三）建信稳健、建信进取份额概要

1、 存续期限

自基金合同生效之日起存续。

2、 基金份额配比

建信稳健份额与建信进取份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比率不变。

3、 建信稳健、建信进取份额净值计算原则

本基金对建信稳健、建信进取份额风险和收益特性的安排不同，其净值计算遵循以下原则：

(1) 建信稳健份额约定年基准收益率为“一年期同期银行定期存款利率+3.5%”，一年期同期银行定期存款利率以当年1月1日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。年基准收益均以1.00元为基准进行计算；

建信稳健份额的约定年基准收益率除以365得到建信稳健份额的约定日收益率。

(2) 本基金每个工作日对建信稳健份额和建信进取份额进行基金份额参考净值计算。在进行建信稳健份额和建信进取份额各自的基金份额参考净值计算时，本基金净资产优先确保建信稳健份额的本金及建信稳健份额累计约定日收益，之后的剩余净资产计为建信进取份额的净资产。建信稳健份额累计约定日收益按依据建信稳健份额约定年基准收益率计算的每日单利和截至计算日建信稳健份额应计收益的天数确定；

(3) 每10份建信双利基金份额所代表的4份建信稳健份额和6份建信进取份额分别计入建信稳健份额总额和建信进取份额总额进行净值计算，并将分别按分离后的建信稳健份额和建信进取份额的份额数享有获得份额折算的权利，每10份建信双利基金份额所代表的资产净值等于4份建信稳健份额和6份建信进取份额的资产净值之和；

(4) 若在本基金存续的完整会计年度内未发生《基金合同》约定的份额折算事项，建信稳健份额应计收益的天数按该会计年度年初至计算日的实际天数计算；在本基金的基金合同生效日所在会计年度，或者在某一会计年度内本基金依据《基金合同》之规定进行不定期份额折算的，建信稳健份额在净值计算日应计收益的天数应按照自基金合同生效日、或者最近一次该会计年度内份额折算日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证建信稳健份额的基金份额持有人的约定收益。

(四) 本基金基金份额净值的计算

本基金作为分级基金，按照建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告T日建信双利基金份额的基金份额净值和建信稳健份额、建信进取份额的基金份额参考净值：

1、建信双利基金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。

T 日建信双利基金份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金，T 日本基金基金份额的总数为建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额的份额数之和。

2、建信稳健份额和建信进取份额 T 日的基金份额参考净值计算

$$NAV(A)_T = 1 + \frac{(R + 3.5\%) \times t}{365}$$

$$NAV(B)_T = \frac{[NAV_t - 0.4 \times NAV(A)_T]}{0.6}$$

其中：

$NAV(A)_T$ 为 T 日建信稳健份额的参考净值；

$NAV(B)_T$ 为 T 日建信进取份额的参考净值；

$t = \min\{\text{自年初至 T 日的天数, 自基金合同生效日至 T 日的天数, 自最近一次会计年度内份额不定期折算日至 T 日的天数}\}$ ；

R 为一年期同期银行定期存款利率。

建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

五、基金份额的发售

本基金基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元，按初始发售面值发售。

（一）募集期

自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间见《招募说明书》及《发售公告》。

（二）发售对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

（三）募集目标

本基金的募集目标详见招募说明书的有关规定。

（四）发售方式和销售渠道

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，投资者场外认购所得的全部份额及认购款项在募集期间产生的利息折算而成的份额将确认为建信双利基金份额；投资者场内认购所得的全部份额及认购款项在募集期间产生的利息折算而成的份额将按 4:6 的比例确认为建信稳健份额与建信进取份额。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。在募集期内，基金投资者可对本基金进行多次认购，认购申请一经受理不得撤销。本基金的具体发售方式和发售机构见《招募说明书》或《发售公告》。

基金发售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

（五）认购费用

本基金场外认购以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用，认购费率最高不超过认购金额的 5%，具体在招募说明书中列示。场内会员单位应按照场外认购费设定投资者场内认购的认购费用。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

（六）募集期利息的处理方式

《基金合同》生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，不得动用。认

购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

（七）基金认购份额的计算

1、基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。具体计算方法请参见《招募说明书》。

场外认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

2、基金场内认购采用份额认购的方式。场内认购金额、经确认的建信稳健份额、经确认建信进取份额的计算方法在《招募说明书》中列示。

场内认购金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入。经确认的建信稳健份额、建信进取份额保留至整数位（最小单位为1份），余额计入基金财产。

3、本基金具体认购费率详见本基金的《招募说明书》和《发售公告》。

（八）基金份额的认购和持有限额

基金管理人可以对每个账户的认购和持有基金份额进行限制，具体限制请参见《招募说明书》或相关公告。

六、基金备案

（一）基金备案的条件

1、本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3、本基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成的基金份额，归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

（二）基金募集失败

1、基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后 30 日内退还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

七、建信稳健、建信进取的上市与交易

（一）上市交易的基金份额

本基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请建信稳健、建信进取上市交易。建信稳健与建信进取两类基金份额同时申请上市与交易，交易代码不同；投资者可以在二级市场单独交易建信稳健或者建信进取；基金份额交易按照深圳证券交易所交易规则及相关规定执行。

（二）上市交易的地点

深圳证券交易所。

建信稳健、建信进取份额上市后，登记在中国证券登记结算有限公司场内证券登记结算系统中的建信稳健和建信进取份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在场外中国证券登记结算有限公司注册登记系统中的建信双利基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记结算系统，并且发起份额分离请求，建信双利基金份额成功分离为建信稳健、建信进取后，方可上市交易。

（三）上市交易的时间

建信稳健、建信进取于本基金合同生效后三个月内开始在深圳证券交易所上市交易；在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

（四）上市交易的规则

1、建信稳健份额、建信进取份额上市首日的开盘参考价为前一交易日建信稳健份额、建信进取份额参考净值；

2、建信稳健份额、建信进取份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；

3、建信稳健份额、建信进取份额买入申报数量为100份或其整数倍；

4、建信稳健份额、建信进取份额申报价格最小变动单位为0.001元人民币；

5、建信稳健份额、建信进取份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

（五）上市交易的行情揭示

建信稳健、建信进取在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示建信稳健、建信进取前一交易日的基金份额参考净值。

（六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

建信稳健、建信进取的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》及深圳证券交易所的相关规定执行。

（七）上市交易的其他规定

相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

八、基金份额的申购与赎回

基金管理人对接信双利基金份额开放申购与赎回业务。建信双利基金份额的申购与赎回包括场内申购与赎回和场外申购与赎回两种方式。

（一）申购与赎回场所

场内申购与赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位（具体名单见基金份额发售公告及开放申购赎回公告）。

场外申购赎回场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构（具体名单见基金份额发售公告及开放申购赎回公告）。

基金投资者应当在上述销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构，并予以公告。

（二）申购与赎回的开放日及时间

本基金建信双利基金份额的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人互联网网站（以下简称“网站”）公告。

申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日3个工作日前在指定媒体公告。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的建信双利基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、先进先出原则，即在基金份额持有人赎回基金份额、基金管理人对该基金份额持有人的基金份额进行赎回处理时，认购、申购确认日期在前的基金份额先

赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案；

6、本基金的申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购建信双利基金份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的建信双利基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者资金账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人资金账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

（五）申购与赎回的数额限制

1、基金管理人可以规定投资者首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回

的最低建信双利基金份额。具体规定请参见《招募说明书》；

2、基金管理人可以规定投资者每个交易账户的最低建信双利基金份额余额。具体规定请参见《招募说明书》；

3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的建信双利基金份额上限。具体规定请参见《招募说明书》；

4、基金管理人可以规定基金总规模上限、当日申购建信双利基金份额金额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告；

5、基金管理人可以规定单个投资人当日申购建信双利基金份额金额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告；

6、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案；

7、当接受建信双利基金份额申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

（六）申购费用和赎回费用

1、建信双利基金份额的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用在投资者赎回建信双利基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

3、建信双利基金份额申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

4、本基金建信双利基金份额的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以根据

《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（七）申购份额与赎回金额的计算

1、场外申购份额的计算

申购建信双利基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。场外申购份额的计算方法请参见《招募说明书》。

场外申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

2、场内申购份额的计算

申购建信双利基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。场内申购份额的计算方法请参见《招募说明书》。

场内申购份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

3、赎回净额的计算

场内赎回和场外赎回计算方法相同。基金份额持有人在赎回建信双利基金份额时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。赎回净额的计算方法请参见《招募说明书》。

赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

建信双利基金份额场内申购、场外申购和场内外赎回的具体例证见《招募说明书》。

4、基金份额净值计算

本基金建信双利基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4

位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（八）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

（九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的全部或部分申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （3）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （4）本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- （5）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行；
- （6）《基金合同》约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；
- （7）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人暂停估值并采取暂停接受基金申购申请的措施；
- （8）基金管理人接受某笔或者某些申购申请或基金转换入申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者变相规避前述 50%比例要求的情形时；

(9) 申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、建信双利基金份额单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔建信双利基金份额申购金额上限、单一投资人累计持有份额上限的情形；

(10) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（7）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停申购公告。暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

(十) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

(1) 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

(2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续2个或2个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(4) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行；

(5) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人暂停估值并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

(6) 《基金合同》约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回

款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停建信双利基金份额的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

（十一）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，建信双利基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额（包括建信双利基金份额、建信稳健份额及建信进取份额）的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额（包括建信双利基金份额、建信稳健份额及建信进取份额）的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若本基金发生巨额赎回、在单个基金份额持有人超过上一日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人有权对于该基金份额持有人当日超过上一日基金总份额 20%以上的那部分赎回申请进行延期办理，对于该基金份额持有人

其余赎回申请部分，基金管理人有权根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 3 个工作日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

连续 2 个或 2 个以上开放日发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

（十二）重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登建信双利基金份额重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的建信双利基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登建信双利基金份额重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的建信双利基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站连续刊登建信双利基金份额重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的建信双利基金份额净值。

（十三）基金的转换

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金建信双利基金份额和基金管理人管理的、已开通基金转换业务的其他基金之间的转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

（十四）基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

1、基金份额的登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的建信双利基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购的建信双利基金份额或上市交易买入的建信稳健份额和建信进取份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的建信稳健份额和建信进取份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。登记在证券登记结算系统中的建信双利基金份额可以直接申请场内赎回，登记在注册登记系统中的建信双利基金份额可申请场外赎回。

2、系统内转托管

（1）系统内转托管是指持有人将持有的建信双利基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

（2）建信双利基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有建信双利基金份额的系统内转托管。

（3）建信双利基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位（席位）时，可办理已持有建信双利基金份额的系统内转托管。

（4）募集期内不得办理系统内转托管。

3、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指持有人将持有的建信双利基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

（2）本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

（3）投资者采用基金管理人直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额将不能办理跨系统转托管业务。若网上交易有关规定及业务规则发生变更，基金管理人可为投资者采用直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额办理跨系统转托管时，届时基金管理人将做出调整并及时公告。

（十五）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理建信双利基金份额的定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

（十六）基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法强制执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

（十七）基金的冻结与解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金注册登记机构的相关规定办理。

九、场内份额的配对转换

本基金《基金合同》生效后，在建信稳健份额、建信进取份额的存续期内，本基金份额持有人可办理场内份额配对转换业务。

（一）场内份额配对转换

1、场内份额的分拆，指场内持有人将其所持有的“建信双利基金份额”按照4:6的比例分拆成“建信稳健份额”与“建信进取份额”，即每10份“建信双利基金份额”分拆成4份“建信稳健份额”与6份“建信进取份额”的行为。

2、场内份额的合并，指场内持有人将其所持有的“建信稳健份额”与“建信进取份额”按照4:6的比例合并成“建信双利基金份额”，即每4份“建信稳健份额”与6份“建信进取份额”合并成10份“建信双利基金份额”的行为。

3、场外的建信双利基金份额不进行份额配对转换。在场外建信双利基金份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

（二）业务办理机构

本基金场内份额配对转换业务的办理机构见《招募说明书》或基金管理人届时发布的相关公告。深圳证券交易所、基金登记结算机构或基金管理人可根据情况变更或增减该业务的办理机构，并予以公告。

（三）业务办理时间

场内份额配对转换自建信稳健份额、建信进取份额上市交易后不超过6个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理该业务前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站上予以公告。

（四）业务办理程序

场内份额配对转换程序遵循深圳证券交易所、基金登记结算机构的最新业务规则，具体见相关业务公告。

（五）暂停场内份额配对转换的情形

1、深圳证券交易所、基金登记结算机构、业务办理机构因异常情况无法办理该业务的情形。

2、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情况的，基金管理人应在至少一家指定媒体及基金管理人网站就暂

停场内份额配对转换业务予以公告。

当恢复场内份额配对转换业务时，基金管理人也将在至少一家指定媒体及基金管理人网站予以公告。

（六）业务办理费用

本基金场内份额配对转换业务的办理机构可对该业务的办理酌情收取一定的费用，具体见招募说明书及相关业务公告。

十、基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：许会斌

成立时间：2005年9月19日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]158号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

存续期间：持续经营

（二）基金托管人

名称：招商银行股份有限公司（简称：招商银行）

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：李建红

成立时间：1987年3月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；同业拆借；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。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.19 亿元

存续期间：持续经营

（三）基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

（四）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、审计师、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。

（五）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、计算并公告建信双利基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的份额参考净值，确定建信双利基金份额申购、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。

（六）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；

- 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。

（七）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建信双利基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的份额参考净值和建信双利基金份额申购、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。

（八）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、依法转让其持有的建信稳健份额与建信进取份额，依法申请赎回其持有的建信双利基金份额；

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。

（九）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、基金合同其他当事人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。

（十）本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

十一、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取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在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

(二) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 提前终止基金合同；

(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) 单独或合计持有建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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，就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(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，法律法规要求增加基金费用收取；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更收费方式、调整建信双利基金份额的申购费率、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。

(三) 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，基金托管人就同一事项仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、单独或合计代表建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计代表建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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、单独或合计代表建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计代表建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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。

(四) 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 天在指定媒体公告。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；

(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。

(五) 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建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额应占权益登记日各自基金份额的 50%以上（含 50%）；

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建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额占权益登记日各自基金份额的 50%以上（含 50%）；

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。

（六）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建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提提交召集人并由召集人公告。

（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。如将其提案进行分类表决，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建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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，则由出席大会的建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人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。

（七）决议形成的条件、表决方式、程序

1、建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

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建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额持有人（或其代理人）各自所持表决权的 50%以上（含 50%）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；法律法规另有规定时，从其规定。

（2）特别决议

特别决议须经出席会议的建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额持有人（或其代理人）各自所持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。

（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、基金托管人共同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三名监票人进行计票，

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（二）条所规定的第（1）-（8）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（二）条所规定的第（9）、（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) 法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

十二、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

（一）基金管理人的更换

1、基金管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- （1）基金管理人被依法取消基金管理资格；
- （2）基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- （3）基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- （4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；

（2）决议：基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

（3）核准：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

（4）交接：原基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金资产总值和基金资产净值；

（5）审计：原基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支；

（6）公告：基金管理人更换后，由基金托管人在新任基金管理人获得中国证监会核准后 2 日内公告；

(7) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。

(二) 基金托管人的更换

1、基金托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- (1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；
- (2) 基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；
- (3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过；新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

(3) 核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4) 交接：原基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值和基金资产净值；

(5) 审计：原基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支；

(6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在新任基金托管人获得中国证监会核准后 2 日内公告。

(三) 基金管理人与基金托管人同时更换

1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有建信双

利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

2、基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上联合公告。

（四）新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。

十三、基金的托管

基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

十四、基金份额的注册登记

(一) 本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

(二) 本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在注册登记业务中的权利义务，保护基金份额持有人的合法权益。

(三) 注册登记机构享有如下权利：

- 1、建立和管理投资人基金账户；
- 2、取得注册登记费；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则并依法公告；
- 5、法律法规规定的其他权利。

(四) 注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；
- 3、保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录 15 年以上；
- 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
- 5、按基金合同和招募说明书规定为投资人办理非交易过户等业务，并提供其他必要服务；
- 6、接受基金管理人的监督；
- 7、法律法规规定的其他义务。

十五、基金的投资

（一）投资目标

本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

（二）投资范围

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和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的相关规定）。如法律法规和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。

本基金为股票型基金，基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（三）投资理念

较高仓位、主题挖掘、个股精选。具体来说，包含以下三方面的内容：

1、较高仓位

本基金的股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，通过减少对股票市场趋势的主观判断，坚持既定且稳定的投资风格和策略，以获取长期较高的资本利得。

2、主题挖掘

本基金建立自上而下的投资主题分析框架，综合运用定量和定性分析方法，通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题。

本基金投资于核心主题企业的股票比例不低于基金股票资产的 80%。

3、个股精选

本基金将精选那些受惠于投资主题并具有竞争力的上市公司进行投资。

（四）投资策略

1、大类资产配置策略

根据现代投资组合理论，资产配置决策应该基于对大类资产的预期收益率、风险水平及其相关性的判断而制定，本基金将以此为出发点，对于可能影响资产预期收益率、风险水平和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪，据此制定基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，并进行定期或不定期调整，以达到控制风险、增加收益的目的。

此外，基金管理人还将关注其他可能影响资产预期收益率与风险水平的因素，观察市场信心指标、行业动量指标等，力争捕捉市场由于低效或失衡而产生的投资机会。

通常情况下，基金管理人会定期根据市场变化，以研究结果为依据对当前资产配置进行评估并作必要调整。在特殊情况下，亦可针对市场突发事件等进行及时调整。本基金资产配置具体调整流程如下：

（1）计算股票市场估值水平；

（2）分析宏观经济运行特征，预测未来经济增长率、行业、公司的盈利增长率，分析债券预期收益率；

（3）综合比较股票市场估值、债券收益率以及未来公司盈利增长，确定资产组合配置；

（4）根据资产组合调整规模、市场股票资金供需状况，将对不同调整方案的风险、收益进行模拟，确定最终资产配置方案。

2、股票投资组合策略

（1）主题筛选策略

本基金将通过自上而下的方式，从社会、文化、科技、国内外宏观经济、国家政策、资本市场发展情况等多个角度出发，在深入研究的基础上，通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题。

按照主题产生的大类原因，本基金将主要关注以下五类主题：政策促进类主题、模式转化类主题、科技进步类主题、投资工具增加类主题、事件类主题，通

通过对投资主题的细分，可以帮助本基金更好地把握主题的发展规律，并且有利于本基金对于同类主题投资机会的对比分析。

（2） 主题配置策略

在主题筛选的基础上，本基金将综合考虑主题产生原因、主题景气程度、主题投资可行性、主题估值水平等因素，确定每个主题的配置权重范围，从而进行主题配置。

分析主题产生的原因以及原因的可持续性决定主题配置的首要因素。在主题产生的初期，本基金将对其产生的原因进行分析，同时通过分析促进主题发展的各项原因的可持续性、对产生原因相同或者相似的主题进行对比分析，选择出发展前景良好、具有投资价值的主题。

主题的景气程度分析主要包括投资者对主题的关注程度分析、主题的发展阶段分析等方面，随着市场对主题关注程度的变化以及主题发展阶段的变化，本基金将对主题的配置比例进行调整。

主题投资可行性主要考察主题市场容量、流动性、覆盖率等因素，本基金选用流通市值占比、总市值和日均成交金额等作为主题市场投资可行性的参考指标。

主题市场估值是指主题覆盖个股的估值指标均值，本基金将选用市盈率、市净率和市销率等作为市场估值的参考指标。

（3） 个股投资策略

在前述主题筛选和主题配置的基础上，本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。

具体分以下两个层次进行股票挑选：

A、备选主题企业股票库投资策略

在确立投资主题及投资主题配置比例之后，本基金将选择受益于投资主题并且具有良好竞争能力的股票进入备选库，具体来说本基金对上市公司受益程度以及竞争能力考核的指标主要有：

I、受益程度筛选

主要包括公司盈利模式、公司业绩受主题驱动的程度以及持续性、类似公司受主题驱动程度的比较、公司业绩弹性等。

II、竞争能力筛选

主要包括包括公司治理结构、管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、是否具有垄断性资源、是否具有行业壁垒、是否有专有技术、特许权、品牌知名度、是否是行业垄断或寡头垄断者等。

B、精选主题企业股票库投资策略

在主题企业备选股票库的基础上，本基金将通过三类指标的筛选最终确定精选主题企业股票库：

I、财务指标筛选

主要包括偿债能力分析指标、营运能力分析指标、盈利能力分析指标、发展能力分析指标四个方面。

II、估值指标筛选

主要包括 PE、PB、EV/EBITDA、PS 等指标。

III、流动性指标

主要包括流通市值、总市值、日均成交金额、换手率等指标。

3、债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：

（1）久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

（2）收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、可转债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对公司债、

可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和风险管理，获取超额收益。

（4）个券精选策略

个券精选策略指基于对信用质量、期限和流动性等因素的考察，重点关注具有以下特征的债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善、期权价值被低估，或者属于创新品种而价值尚未被市场充分发现的个券。通过深入研究，发掘这些具有较高当期收益率或者较高升值潜力的债券，可为投资者创造超额投资回报。

4、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

（五）投资管理体制及流程

1、投资管理体制

本基金管理人建立了包括投资决策委员会、投资管理部、研究部、交易部等部门的完整投资管理体系。

投资决策委员会是负责基金资产运作的最高决策机构，根据基金合同、法律法规以及公司有关规章制度，确定公司所管理基金的投资决策程序、权限设置和投资原则；确定基金的总体投资方案；负责基金资产的风险控制，审批重大投资事项；监督并考核基金经理。投资管理部及基金经理根据投资决策委员会的决策，构建投资组合、并负责组织实施、追踪和调整，以实现基金的投资目标。研究部提供相关的投资策略建议和证券选择建议，并负责构建和维护股票池。交易部根据基金经理的交易指令，进行基金资产的日常交易，对交易情况及时反馈。

2、投资流程

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理体制，具体的投资管理流程见图 1。

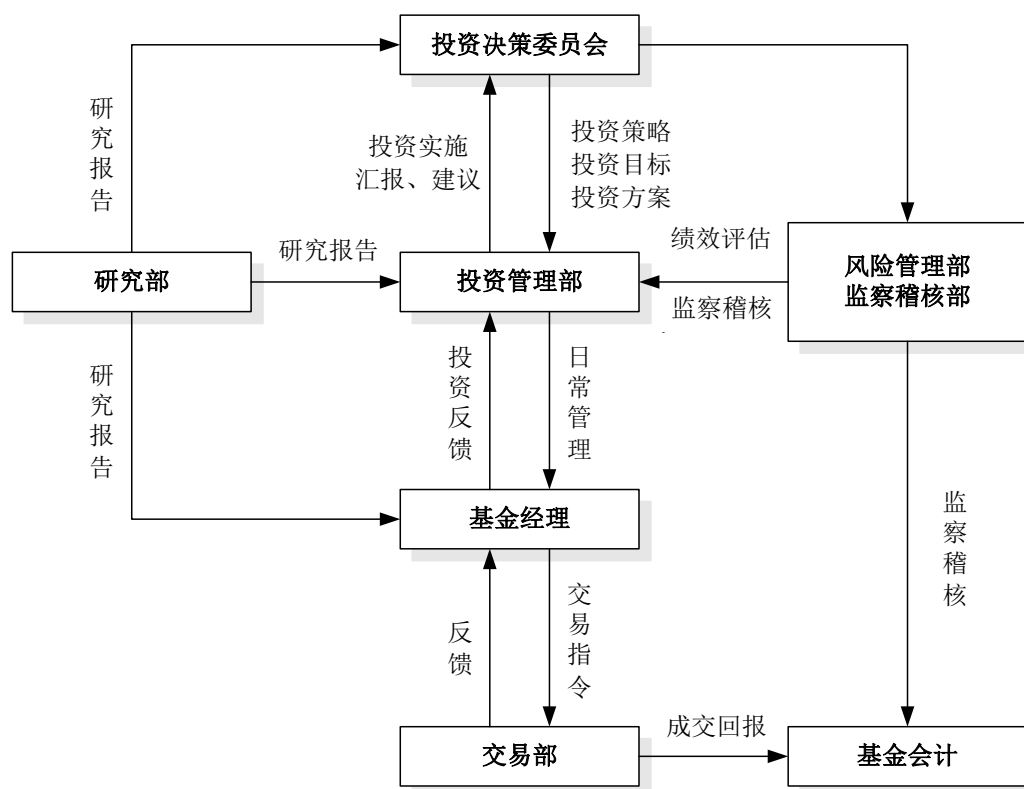


图 1 基金投资管理流程示意图

(1) 研究分析

研究部及投资管理部广泛地参考和利用公司内、外部的研究成果，走访拟投资公司或其他机构，进行深入细致的调查研究，了解国家宏观经济政策及行业发展状况，挖掘有投资价值的拟投资上市公司，同时，建立相关研究模型。研究部撰写宏观策略报告、行业策略报告和拟投资上市公司投资价值分析等报告，作为投资决策依据之一。

研究部和投资管理部定期或不定期举行投资研究联席会议，讨论宏观经济、行业、拟投资上市公司及相关问题，作为投资决策的重要依据之一。

(2) 投资决策

投资决策委员会根据基金合同、相关法律法规以及公司有关规章制度确定基金的投资原则以及基金的资产配置比例范围，审批总体投资方案以及重大投资事项。

基金经理根据投资决策委员会确定的投资对象、投资结构、持仓比例范围等总体投资方案，并结合研究人员提供的投资建议、自己的研究与分析判断、以及基金申购赎回情况和市场整体情况，构建并优化投资组合。对于超出权限范围的

投资，按照公司权限审批流程，提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

（3）交易执行

交易部接受基金经理下达的交易指令。交易部接到指令后，首先应对指令予以审核，然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的，交易部可以暂不执行指令，并即时通知基金经理或相关人员。

交易部应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议，以便基金经理及时调整交易策略。

（4）投资回顾

绩效评估小组定期对基金绩效进行评估。基金经理定期向投资决策委员会回顾前期投资运作情况，并提出下期的操作思路，作为投资决策委员会决策的参考。

（六）投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、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债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本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的比例为 90%-95%；

- (2) 本基金持有的固定收益类证券和现金占基金资产的比例为 5%—10%；
- (3) 本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (4) 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%；
- (5) 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%；
- (6) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (7) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- (8) 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%；
- (9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (11) 本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上（含 **BBB**）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (12) 本基金持有的债券其信用级别不低于 **BBB** 级；
- (13) 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；

- (14) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- (15) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- (17) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

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约定。除上述第（3）、（11）、（15）、（16）项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定比例的，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

（七）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ 。

如果基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的业绩比较基准，并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

（八）风险收益特征

本基金属于采用高仓位操作的股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。

从本基金所分离的两类基金份额来看，建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额；建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征，其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

（九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（十）基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

十六、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

（二）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。

（三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关法律法规处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十七、基金资产的估值

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

（二）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）

估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、交易所停止交易等非流通品种的估值。因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

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，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（四）估值程序

1、建信双利基金份额净值是按照每个开放日闭市后，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 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。建信稳健份额与建信进取份额的份额参考净值精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。

每个工作日计算基金资产净值及建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取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。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（五）基金份额净值的计算

1、建信双利基金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。

T 日建信双利基金份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金，T 日本基金基金份额的总数为建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额的份额数之和。

2、建信稳健份额和建信进取份额 T 日的基金份额参考净值计算

$$NAV(A)_T = 1 + \frac{(R + 3.5\%) \times t}{365}$$

$$NAV(B)_T = \frac{[NAV_t - 0.4 \times NAV(A)_T]}{0.6}$$

其中：

$NAV(A)_T$ 为 T 日建信稳健份额的参考净值；

$NAV(B)_T$ 为 T 日建信进取份额的参考净值；

$t = \min\{\text{自年初至 T 日的天数, 自基金合同生效日至 T 日的天数, 自最近一次会计年度内份额不定期折算日至 T 日的天数}\}$ ；

R 为一年期同期银行定期存款利率。

建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当建信双利基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）内发生差错时，视为建信双利基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；

若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的

损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4、建信双利基金份额差错处理的原则和方法如下：

(1) 建信双利基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 建信双利基金份额净值的错误偏差达到建信双利基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到建信双

利基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

(3) 因建信双利基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商确认后，决定暂停基金估值时；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(八) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

(九) 特殊情况的处理

1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十八、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金上市费用；
- 4、基金财产拨划支付的银行费用；
- 5、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。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，基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。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、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 个工作日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

本基金运作过程中的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规履行。

十九、基金的收益与分配

（一）收益的构成

本基金合同项下基金收益指基金利润，包括：

- 1、利息收入。
- 2、公允价值变动收入。
- 3、投资收益。
- 4、其他收入。

基金已实现收益为基金利润减去公允价值变动后的余额。因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

基金期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（二）收益分配原则

本基金不进行收益分配，也不单独对建信稳健份额与建信进取份额进行收益分配。

二十、基金份额的折算

（一）定期份额折算

在建信稳健份额、建信双利基金份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

1、基金份额折算基准日

每个会计年度第一个工作日。

2、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。

3、基金份额折算频率

每年折算一次。

4、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

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

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

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：

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

$NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}$ ：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。

在实施基金份额折算时，折算日折算前建信双利基金份额的份额净值、建信稳健份额的份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

具体例证详见招募说明书。

5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停建信稳健份额与建信进取份额的上市交易和建信双利基金份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果，并报中国证监会备案。

7、特殊情形的处理

若在某一会计年度最后一个工作日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

（二）不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当建信双利基金份额的基金份额净值达到 2.000 元；当建信进取份额的基金份额净值达到 0.200 元。

1、不定期折算情形一：

当建信双利基金份额的基金份额净值达到 2.000 元，本基金将按照以下规则

进行份额折算。

(1) 基金份额折算基准日

建信双利基金份额的基金份额净值达到 2.000 元时，基金管理人即可确定折算基准日。

(2) 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、建信进取份额和建信双利基金份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当建信双利基金份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保建信稳健份额和建信进取份额的比例为 4：6，份额折算后建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

建信稳健份额、建信进取份额、建信双利基金份额三类份额按照如下公式进行份额折算：

① 建信稳健份额

份额折算原则：

A、份额折算前建信稳健份额的份额数与份额折算后建信稳健份额的份额数相等；

B、建信稳健份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1.000 元以上的净值部分全部折算为场内建信双利基金份额。

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

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

其中：

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

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

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

② 建信进取份额

份额折算原则：

A、份额折算后建信进取份额与建信稳健份额保持 4：6 配比；

B、份额折算前建信进取份额的资产与份额折算后建信进取份额的资产及其新增场内建信双利基金份额的资产之和相等；

C、份额折算前建信进取份额的持有人在份额折算后将持有建信进取份额与新增场内建信双利基金份额。

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

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

其中：

$NAV_{\text{进取}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信进取份额净值

$NUM_{\text{进取}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信进取份额的份额数

$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}$ ：份额折算后建信进取份额的份额数

③ 建信双利基金份额

份额折算原则：

场外建信双利基金份额持有人份额折算后获得新增场外建信双利基金份额，场内建信双利基金份额持有人份额折算后获得新增场内建信双利基金份额。

$$NUM_{\text{双利}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{双利}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{双利}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信双利基金份额的份额净值

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

$NUM_{\text{双利}}^{\text{后}}$ ：份额折算后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。

在实施基金份额折算时，折算日折算前建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额净值、建信进取份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

具体例证详见招募说明书。

（5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停建信稳健份额与建信进取份额的上市交易和建信双利基金份额的申购或赎回相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果，并报中国证监会备案。

2、不定期折算情形二：

当建信进取份额的基金份额净值达到 0.200 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

（1）基金份额折算基准日

建信进取份额的基金份额净值达到 0.200 元，基金管理人即可确定折算基准日。

（2）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、建信进取份额、建信双利基

金份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当建信进取份额的基金份额净值达到 0.200 元后，本基金将分别对建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保建信稳健份额和建信进取份额的比例为 4: 6，份额折算后建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

建信稳健份额、建信进取份额、建信双利基金份额三类份额按照如下公式进行份额折算。

① 建信进取份额

份额折算原则：

份额折算前建信进取份额的资产与份额折算后建信进取份额的资产相等。

$$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{进取}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{进取}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{进取}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信进取份额净值

$NUM_{\text{进取}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信进取份额的份额数

$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}$ ：份额折算后建信进取份额的份额数

② 建信稳健份额

份额折算原则：

A、份额折算前后建信稳健份额与建信进取份额始终保持 4: 6 配比；

B、份额折算前建信稳健份额的资产与份额折算后建信稳健份额的资产及其新增场内建信双利基金份额的资产之和相等；

C、份额折算前建信稳健份额的持有人在份额折算后将持有建信稳健份

额与新增场内建信双利基金份额。

$$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}}{6} \times 4$$

$$NUM_{\text{双利}}^{\text{场内}} = \frac{NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

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

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

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

$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}$ ：份额折算后建信进取份额的份额数

$NUM_{\text{双利}}^{\text{场内}}$ ：份额折算前建信稳健份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内建信双利基金份额的份额数

③ 建信双利基金份额：

份额折算原则：

份额折算前建信双利基金份额的资产与份额折算后建信双利基金份额的资产相等。

$$NUM_{\text{双利}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{双利}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{双利}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信双利基金份额的份额净值

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

$NUM_{\text{双利}}^{\text{后}}$ ：份额折算后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。

在实施基金份额折算时，折算日折算前建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额净值、建信进取份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

具体例证详见招募说明书。

（5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停建信稳健份额与建信进取份额的上市交易和建信双利基金份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果，并报中国证监会备案。

二十一、基金的会计和审计

（一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

（二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在2个工作日内指定媒体上公告。

二十二、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

（一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中

国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

（二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

（三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

（四）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

（五）建信稳健份额与建信进取份额上市交易公告书

本基金建信稳健份额与建信进取份额获准在证券交易所上市交易后，基金管理人将在上市交易3个工作日前，将建信稳健份额与建信进取份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

（六）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，在开始办理建信双利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建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值；

2、在开始办理建信双利基金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，披露开放日的建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值、建信进取份额参考净值和建信双利基金份额累计净值；

3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值、建信进取份额参考净值和建信双利基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（七）建信双利基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明建信双利基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

（八）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1、基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2、基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3、基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5、基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6、基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等；

基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

（九）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；

- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、建信双利基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加或减少代销机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、建信双利基金份额开始办理申购、赎回；
- 22、建信双利基金份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、建信双利基金份额发生巨额赎回并延期支付；
- 24、建信双利基金份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、建信双利基金份额暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、本基金接受或暂停接受配对转换申请；
- 27、本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
- 28、本基金实施基金份额折算；
- 29、建信稳健份额、建信进取份额暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 30、在发生涉及建信双利基金份额申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎

回等重大事项时；

31、中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

(十) 澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(十一) 基金份额持有人大会决议

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。

(十二) 中国证监会规定的其他信息

(十三) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值、建信进取份额参考净值、建信双利基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金托管人在基金年度报告、半年度报告等信息披露文件中出具基金托管人报告。托管人报告应说明基金托管人和基金管理人履行基金合同的情况。

基金管理人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

(十四) 信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取

份额参考净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）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）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

（9）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基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

（3）因相应的法律法规及交易所的有关规则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。

（二）本基金合同的终止

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、法律法规及中国证监会规定的其他情况。

（三）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）基金财产清算组制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （7）聘请律师事务所出具法律意见书；
- （8）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （9）公布基金财产清算结果；
- （10）对基金剩余财产进行分配；

(11) 基金财产清算的期限为 6 个月。

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) 按基金份额持有人持有的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。

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，分别计算建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自的应计分配比例，并据此向建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自的基金份额持有人根据其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。

二十四、违约责任

（一）基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1、不可抗力；

2、基金管理人、基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

4、基金托管人对于不在其能控制范围内的基金财产中证券、债券等有价值证券等实物的毁损造成的损失。

（二）基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。

（三）本基金合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（四）因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

（五）由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

二十五、争议的处理

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。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。

二十六、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

（一）本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（二）本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

（三）本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人和基金托管人分别持有二份，每份具有同等法律效力。

（四）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。

二十七、其他事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

本页无正文，为《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》的签字盖章页。

基金管理人：建信基金管理有限责任公司（公章）

法定代表人或授权代表：

基金托管人：招商银行股份有限公司（公章）

法定代表人或授权代表：

签订地点：

签订日： 年 月 日