

诺德双翼分级债券型证券投资基金之双翼 B
基金份额上市交易公告书

基金管理人： 诺德基金管理有限公司
基金托管人： 华夏银行股份有限公司
注册登记机构： 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 4 月 23 日
公告日期： 2012 年 4 月 18 日

目 录

	页码
一、重要声明与提示	3
二、基金概览	3
三、基金的募集与上市交易	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	5
五、基金主要当事人简介	6
六、基金合同摘要	8
七、基金财务状况	8
八、基金投资组合	9
九、重大事件揭示	12
十、基金管理人承诺	12
十一、基金托管人承诺	12
十二、备查文件目录	12
附件：基金合同内容摘要	

一、重要声明与提示

诺德双翼分级债券型证券投资基金之双翼 B 基金份额上市交易公告书（以下简称“本公告”）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〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，诺德双翼分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人诺德基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告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。本基金托管人华夏银行股份有限公司保证本公告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、深圳证券交易所对本基金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。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2012 年 1 月 5 日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》以及诺德基金管理有限公司网站（www.nuodefund.com）上的《诺德双翼分级债券型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概况

1、基金名称：诺德双翼分级债券型证券投资基金。

2、基金类别：债券型。

3、基金运作方式：契约型基金。本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，双翼 A 自《基金合同》生效之日起每满 6 个月开放一次，双翼 B 封闭运作并上市交易；本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

4、基金份额分级：本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，本基金的基金份额划分为双翼 A、双翼 B 两级份额，两级份额独立发售，所募集的基金资产合并运作。其中，双翼 A 根据《基金合同》的规定获取约定收益，并自基金合同生效之日起每满 6 个月开放一次，接受申购与赎回；本基金在扣除双翼 A 的应计收益后的全部剩余收益归双翼 B 享有，亏损以双翼 B 的资产净值为限由双翼 B 承担；双翼 B 在《基金合同》生效后封闭运作，封闭期为 3 年。

5、基金存续期限：不定期。

6、基金份额总额：本基金总份额 403,706,862.48 份，其中，双翼 A 为 269,131,056.07 份基金份额，双翼 B 为 134,575,806.41 份基金份额（截至 2012 年 4 月 16 日）。

7、双翼 B 基金份额参考净值：1.023 元（截至 2012 年 4 月 16 日）

8、本次上市交易的基金份额简称及代码：双翼 B，代码：150068

9、双翼 B 本次上市交易的基金份额总额：6,672,791.00 份（截至 2012 年 4 月 16 日）

10、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

11、上市交易日期：2012 年 4 月 23 日

12、基金管理人：诺德基金管理有限公司

13、基金托管人：华夏银行股份有限公司

三、双翼 B 的募集与上市交易

（一）双翼 B 上市前募集情况

1、本基金发售申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可[2011]1691 号

2、发售日期：2012 年 1 月 9 日

3、发售面值：1.00 元人民币

4、发售方式：场内、场外认购

5、发售机构：

（1）场内发售机构

已经具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

（2）场外发售机构

1）直销机构：诺德基金管理有限公司。

2）代销银行：华夏银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司。

3）代销券商：长江证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中航证券有限公司、金元证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、上海证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、瑞银证券有限责任公司、厦门证券有限公司、华安证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司。

6、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限责任公司

7、认购资金总额及入账情况：

本次双翼 A 募集的有效认购户数为 2,541 户，净销售金额为人民币 269,098,125.12 元，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币 32,930.95 元；本次双翼 B 募集的有效认购户数为 435 户，净销售金额为人民币 134,549,200.00 元，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币 26,606.41 元。

上述募集资金已于 2012 年 2 月 15 日全额划入本基金在基金托管人华夏银行股份有限公司开立的诺德双翼分级债券型证券投资基金托管专户。

按照每份基金份额初始面值 1.00 元计算,本次募集期的募集资金及其利息结转的份额共计 403,706,862.48 份,其中,双翼 A 为 269,131,056.07 份基金份额,双翼 B 为 134,575,806.41 份基金份额,已全部计入基金份额持有人基金账户,归基金份额持有人所有。

8、基金备案情况

本基金于 2012 年 2 月 15 日验资完毕,2012 年 2 月 16 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 2 月 16 日获得书面确认,本基金基金合同自该日起正式生效。

9、基金合同生效日:2012 年 2 月 16 日。

10、本基金总份额 403,706,862.48 份,其中,双翼 A 为 269,131,056.07 份基金份额,双翼 B 为 134,575,806.41 份基金份额。

(二) 双翼 B 基金份额上市交易的主要内容

1、基金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]89 号

2、上市交易日期:2012 年 4 月 23 日

3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

4、本次上市的基金份额简称:双翼 B

5、本次上市的基金份额交易代码: 150068

6、本次上市交易的双翼 B 份额: 6,672,791.00 份(截至 2012 年 4 月 16 日)

7、基金资产净值的披露:每个工作日的次日公布诺德双翼分级债券型证券投资基金的基金份额净值、双翼 A 份额参考净值和双翼 B 份额参考净值,并在深交所行情发布系统揭示双翼 B 的份额参考净值。

8、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一) 持有人户数

截至 2012 年 4 月 16 日,双翼 B 场内基金份额持有人户数为 133 户,平均每户持有的双翼 B 场内基金份额 50,171.36 份。

(二) 持有人结构

截至 2012 年 4 月 16 日,场内基金份额持有人结构如下:

场内机构投资者持有的场内双翼 B 基金份额 6,000,666.00 份,占比 89.9274%;场内个人投资者持有的场内双翼 B 基金份额 672,125.00 份,占比 10.0726%。

（三）截至 2012 年 4 月 16 日，场内双翼 B 基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例（%）
1	招商证券股份有限公司	3,000,541	44.97
2	金元证券股份有限公司	3,000,125	44.96
3	陈玲玲	100,030	1.50
4	张发友	100,027	1.50
5	辛允香	100,023	1.50
6	邹宜晓	50,015	0.75
7	王斌	50,009	0.75
8	郭育剑	50,009	0.75
9	赵新	38,001	0.57
10	王颖	21,003	0.31

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本情况

名称：诺德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 12 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 12 层

法定代表人：杨忆风

总经理：潘福祥

成立日期：2006 年 6 月 8 日

电话：（021）68879999

传真：（021）68877727

联系人：张欣

注册资本：1 亿元人民币

股权结构：

股东名称	出资比例（%）
Lord, Abbett & Co. LLC	49%
长江证券有限责任公司	30%
清华控股有限公司	21%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作

的风险控制和管理工作,确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则,防范和化解运作风险、合规与道德风险。公司目前设有投资研究部、风险控制部、市场部、清算登记部、信息技术部、监察稽核部。截止到 2012 年 3 月 31 日,公司有员工 76 人,其中 50%以上具有硕士以上学历。

3、本基金基金经理

赵滔滔先生,2012 年 2 月诺德双翼分级债券型证券投资基金成立即任该基金的基金经理。赵滔滔先生具有上海财经大学金融学硕士学位,具有基金从业资格。2006 年 11 月至 2008 年 10 月,任职于平安资产管理有限责任公司。2008 年 10 月加入诺德基金管理有限公司,曾担任债券交易员,固定收益研究员等职务,2010 年 6 月起担任诺德增强收益债券型证券投资基金。

(二) 基金托管人

1、基本情况

名称: 华夏银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

成立时间: 1992 年 10 月 14 日

法定代表人: 吴建

注册资本: 4,990,528,316 元人民币

联系电话: 010-85238667

联系人: 郑鹏

2、主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场综合室、交易管理室、风险管理室和销售管理室 4 个职能处室。资产托管部共有员工 33 人,高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

3、基金托管业务经营情况

华夏银行于 2005 年 2 月 23 日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准,获得证券投资基金托管资格,是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。

自成立以来,华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神,始终遵循“安全保管基金资产,提供优质托管服务”的原则,坚持以客户为中心的服务理念,依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验,严格履行法律和托管协议所规定的各项义务,为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。华夏银行目前已托管长城货币市场基金、国联安德盛精选股票基金、万家货币市场基金、诺安优化收

益债券型基金、益民红利成长混合型基金、东吴行业轮动股票基金、申万巴黎稳益宝债券型基金、诺德双翼分级债券型证券投资基金等基金产品及其它受托资产产品。

（三）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：张鸿

经办注册会计师：汪棣、张鸿

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本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。

诺德双翼分级债券型证券投资基金 2012 年 4 月 16 日资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资 产	本期末 2012 年 4 月 16 日
资产：	
银行存款	136,175,291.10
结算备付金	3,002,543.44
存出保证金	250,000.00
交易性金融资产	415,442,238.34
其中：股票投资	—
债券投资	415,442,238.34
资产支持证券投资	—
基金投资	—
衍生金融资产	—

买入返售金融资产	37,000,000.00
应收证券清算款	1,892,690.10
应收利息	7,632,535.72
应收股利	—
应收申购款	—
其他资产	—
资产合计：	601,395,298.70
负债和所有者权益	
负债：	
短期借款	—
交易性金融负债	—
衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	179,736,930.60
应付证券清算款	12,033,287.92
应付赎回款	—
应付管理人报酬	124,810.93
应付托管费	35,660.27
应付销售服务费	71,320.54
应付交易费用	71.12
应付税费	—
应付利息	122,338.83
应付利润	—
其他负债	324,343.75
负债合计	192,448,763.96
所有者权益：	
实收基金	403,706,862.48
未分配利润	5,239,672.26
所有者权益合计	408,946,534.74
负债与持有人权益总计：	601,395,298.70

八、基金投资组合

截至 2012 年 4 月 16 日，诺德双翼分级债券型证券投资基金的投资组合如下：

（一）期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

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	415,442,238.34	69.08
	其中：债券	415,442,238.34	69.08
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	37,000,000.00	6.15
	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	139,177,834.54	23.14
6	其他资产	9,775,225.82	1.63
7	合计	601,395,298.70	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

注：截至 2012 年 4 月 16 日，本基金未持有股票。

（三）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：截至 2012 年 4 月 16 日，本基金未持有股票。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	16,055,982.50	3.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	399,386,255.84	97.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	415,442,238.34	101.59

(五) 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	122130	11 航民 01	300,000	30,000,000.00	7.34
2	126011	08 石化债	268,680	25,102,772.40	6.14
3	126019	09 长虹债	257,230	22,034,321.80	5.39
4	122122	11 精工债	200,000	20,000,000.00	4.89
5	010203	02 国债(3)	160,510	16,051,000.00	3.93

(六) 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：截至 2012 年 4 月 16 日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 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：截至 2012 年 4 月 16 日，本基金未持有权证。

(八) 投资组合报告附注

1、申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。

截至 2012 年 4 月 16 日，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

截至 2012 年 4 月 16 日，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	1,892,690.10
3	应收股利	—
4	应收利息	7,632,535.72
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,775,225.82

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：截至 2012 年 4 月 16 日，本基金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：截至 2012 年 4 月 16 日，本基金未持有股票。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

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、深圳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》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，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、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会核准基金募集的文件

- (二) 《诺德双翼分级债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《诺德双翼分级债券型证券投资基金招募说明书》
- (四) 《诺德双翼分级债券型证券投资基金托管协议》
- (五) 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

附件：基金合同内容摘要

一、基金合同当事人的权利和义务

(一) 基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。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。

本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，双翼 A、双翼 B 的基金份额持有人持有的每一份基金份额按照《基金合同》约定在各自份额级别内具有同等的合法权益；本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (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) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (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、基金销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。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (3) 在其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《基金合同》当事人合法权益的活动；

(5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

(6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集基金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律、法规监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律、法规决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 在符合有关法律、法规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费率、托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

(13) 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；

(14) 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；

(15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(17) 法律法规和《基金合同》规定的其它权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(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；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售

与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(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、谨慎勤勉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基金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,不得利用基金财产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) 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，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 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；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；

(13) 按《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基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 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；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 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；

(19) 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；

(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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

(23) 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实施其他法律行为；

(24) 基金在募集期间未能达到备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还投资者；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 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；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其它权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，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) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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，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；

(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予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度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；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 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；

(15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 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监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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。

1、本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由双翼 A、双翼 B 的基金份额持有人独立进行表决。双翼 A、双翼 B 的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的投票权。

2、本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。基金份额持有人持有的每一基金份额享有同等的投票权。

（一）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）终止《基金合同》；
 - （2）更换基金管理人；
 - （3）更换基金托管人；
 - （4）转换基金运作方式，但本基金在《基金合同》生效后 3 年期届满时转换为上市开放式基金（LOF）除外；
 - （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
 - （6）变更基金类别；
 - （7）本基金与其他基金的合并；
 - （8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
 - （9）变更基金份额持有人大会程序；
 - （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
 - （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，依据《基金合同》享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、会议表决权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有双翼 A、双翼 B 各自的基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人”或其类似表述。
- （12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
 - （13）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，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；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(5) 对《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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系；

(6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《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。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、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，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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，代表基金份额 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。

5、代表基金份额 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，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。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。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(三) 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、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 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；

- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议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，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开或法律法规和监管机关允许的其他方式。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，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 50%（含 50%）（本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，指“有效的双翼 A 和双翼 B 各自的基金份额分别合计不少于该级基金总份额的 50%（含 50%）”）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决或法律法规和监管机关允许的其他方式。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《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（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通

知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面表决意见或授权他人代表出具书面表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）（本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，指“基金份额持有人所持有的双翼 A 和双翼 B 各自的基金份额分别合计不小于在权益登记日该级基金总份额的 50%（含 50%）”）；

（4）上述第（3）项中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，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

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，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；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。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式由基金份额持有人对其代表进行授权或召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会或通讯开会。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 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 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

（1）关联性。大会召集人对于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了解释和说明。

（2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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。

单独或合并持有权益登记日基金总份额 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，或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。法律法规另有规定除外。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，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）（本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，指“出席大会的双翼 A 和双翼 B 各自的基金份额持有人和代理人所持表决权的 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。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，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 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。但在《基金合同》生效之日起 3 年内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由双翼 A、双翼 B 的基金份额持有人独立进行表决，且双翼 A、双翼 B 的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应的基金份额级别内享有平等表决权。

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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）（本基金《基金合同》生效之日起3年内，指“参加大会的双翼A和双翼B各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）”）通过方为有效；除下列第2项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，特别决议应当经参加大会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）（本基金《基金合同》生效之日起3年内，指“参加大会的双翼A和双翼B各自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）”）通过方可做出。转换基金运作方式（本基金在《基金合同》生效后3年期届满时转换为上市开放式基金（LOF）除外）、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，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表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，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选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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证；基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，

并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒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。

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，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的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。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。

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的决议。

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。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

1、本基金《基金合同》生效之日起 3 年内的收益分配原则

本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，本基金的收益分配原则如下：

- （1）本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，本基金不进行收益分配；
- （2）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的收益分配原则

本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金的收益分配原则如下：

- （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 20%；
- （2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。

场外转入或申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者在不同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式，如投资者在某一销售机构交易账户不选择收益分配方式，则按默认的收益分配方式处理；

场内转入、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（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。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。

（四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定执行。

四、与基金财产管理、运用有关费用的计提、支付方式与比例

（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、基金销售服务费；
 - 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
 - 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
 - 6、基金份额持有人大会费用；
 - 7、基金的证券交易费用；
 - 8、基金的银行汇划费用；
 - 9、基金的上市交易费用；
 - 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
- 本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40%年费率计提。基金销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

五、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

（一）投资目标

本基金在追求基金资产稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

（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、货币市场工具、权证、资产支持证券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的相关规定）。

本基金主要投资于国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、次级债、短期融资券、政府机构债、央行票据、银行同业存款、回购、可转债、可分离债、资产证券化产品等固定收益类金融工具。

本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股与增发新股的申购，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起 90 个交易日内卖出。

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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的具体投资范围及比例分别为：

债券等固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产净值的 80%；

非固定收益类资产的投资比例不超过基金资产净值的 20%；

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。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

（三）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、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%；
- 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- 3、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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- 4、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- 5、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；
- 6、本基金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%；

- 7、本基金持有的同一（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%；
- 8、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，不得超过该基金资产净值的 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%；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；
- 9、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 10、本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过基金资产净值的 5%；本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过基金资产净值的 10%；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；
- 11、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；
- 12、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。如果《基金法》及其他法律法规或监管部门对上述限制进行变更的，履行适当程序后，本基金以变更后的规定为准。

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的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，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。

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。除投资组合资产配置比例外，基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本《基金合同》生效之日起开始。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的净资产值。

2、基金资产净值、基金份额净值的公告方式

《基金合同》生效后，在双翼 A 的首次开放日或者双翼 B 上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值以及双翼 A 和双翼 B 的基金份额参考净值。

在双翼 A 的首次开放或者双翼 B 上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值、双翼 A 和双翼 B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值以及双翼 A 和双翼 B 的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值、双翼 A 和双翼 B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值登载在指定媒体上。

本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露本基金的基金份额净值和基金份额累计净值；基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式，但本基金在《基金合同》生效后 3 年期届满时转换为上市开放式基金（LOF）除外；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止《基金合同》；
- （10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

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后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或调整收费方式；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （5）对《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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- （6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更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，自《基金合同》生效之日起 2 日内在指定媒体公告。

（二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；

- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

- 1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止情形之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。
- 2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。
- 3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。
- 4、基金财产清算程序：
 - （1）出现《基金合同》终止情形后，由基金财产清算小组统一接管基金；
 - （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
 - （3）对基金财产进行估值和变现；
 - （4）制作清算报告；
 - （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
 - （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
 - （7）对基金财产进行分配。
- 5、基金财产清算的期限按照法律法规的相关规定执行。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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小组优先从基金财产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

- 1、本基金在《基金合同》生效之日起 3 年内清算时的基金清算财产分配
本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，如果本基金发生基金财产清算的情形，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，将优先满足双翼 A 的本金及应计收益分配，剩余部分（如有）由双翼 B 的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。
- 2、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的基金清算财产分配
本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，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。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于出现《基金合同》终止情形并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）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

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《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

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

- 结束 -