

# 诺德双翼债券型证券投资基金 ( LOF ) 招募说明书 ( 摘要 ) 更 新 ( 2016 年 9 月 )

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

## 【重要提示】

诺德双翼分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会 2011 年 10 月 24 日证监许可

【2011】1691 号文核准。本基金的基金合同于 2012 年 2 月 16 日生效。根据《基金合同》的有关规定，诺德双翼分级债券型证券投资基金在《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，转换为上市开放式基金（LOF）基金，名称变更为“诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）”，双翼 A、双翼 B 的基金份额转换为上市开放式基金（LOF）份额。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但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。

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

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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，双翼 A 自《基金合同》生效之日起每满 6 个月开放一次，为风险低、预期收益相对稳定的基金份额；双翼 B 封闭运作并上市交易，为风险较高、预期收益较高的基金份额。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，基金名称为“诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）”。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资人认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和《基金合同》。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止至 2016 年 8 月 15 日，财务数据和净值表现截止至 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

基金管理人：诺德基金管理有限公司

住所：上海市浦东陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 12 楼

办公地址：上海市浦东陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 12 楼

邮政编码：200120

法定代表人：潘福祥

成立日期：2006 年 6 月 8 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2006]88 号

经营范围：发起、设立和销售证券投资基金；管理证券投资基金；经中国证监会批准的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）。

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

联系人：孟晓君

联系电话：021-68879999

股权结构：

清华控股有限公司 51%

宜信惠民投资管理（北京）有限公司 49%

管理基金：

诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金，诺德优选 30 混合型证券投资基金、诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德深证 300 指数分级证券投资基金、诺德货币市场基金和诺德天禧债券型证券投资基金。

## （二）主要人员情况

### 1. 基金管理人董事会成员：

潘福祥先生，董事，董事长，清华大学学士、硕士，中国社会科学院金融学博士。历任清华大学经济管理学院院长助理、安徽省国投上海证券总部副总经理和清华兴业投资管理有限公司总经理，清华大学经济管理学院和国家会计学院客座教授，诺德基金管理有限公司董事、副总经理、总经理。

胡志伟先生，董事，总经理，南京大学经济学硕士。历任江苏证券有限责任公司投资银行部业务经理，亚洲控股有限责任公司投资银行部高级经理，2005 年 8 月加入诺德基金管理有限公司至今，先后担任投资研究部行业研究员、基金经理助理、基金经理、投资副总监、投资总监职务。

薛嘉麟先生，董事，华中理工大学工学学士，北京邮电大学工学硕士。现任清控资产管理有限公司副总裁，曾任朗讯科技（中国）有限公司贝尔实验室高级研究员，中关村科技软件有限公司咨询服务总监、副总裁、总裁，北京通软联合信息技术有限公司首席执行官，中国海关网首席运营官，启迪融资租赁有限公司总经理，启迪金控投资有限公司副总裁，清控资产管理有限公司投资业务总监。

唐宁先生，董事，美国 The University of the South 经济学学士。现任宜信惠民投资管理（北京）有限公司执行董事、总经理，华创资本（CGC）董事长，宜信（香港）控股董事长，富安易达（北京）网络技术有限公司总经理，喆颢资产管理（上海）有限公司总经理。曾任美国 DLJ 投资银行部（DLJ Investment Bank）投资分析师，亚信（Asia Info）战略投资部总监。

侯琳女士，董事，北京大学法学学士、硕士。现任宜信惠民投资管理（北京）有限公司副总经理。

Qian Jun 先生，董事，浙江大学学士，美国 The University of Toledo 硕士，美国 Duke University 博士。宜信卓越财富管理（北京）有限公司总裁助理，曾任新华通讯社（北京）工程师，杭州高等专科学校教师，美国债券软件公司（Bond-Tech）金融软件工程师，美洲银行（美国）交易结构团队负责人，摩根士丹利（香港/中国）亚太地区的团队负责人，华宝信托总经理。

陈达飞先生，独立董事，对外经济贸易大学学士，University of Minnesota Law School 硕士。现任北京市汉坤律师事务所律师，曾任北京金杜律师事务所律师，高伟绅律师事务所律师，德普律师事务所律师。

王岚女士，独立董事。北京大学法学学士，法国巴黎商学院（Paris School of Business）及美国华盛顿大学

（University of Washington）访问学者。现任北京德恒律师事务所合伙人，曾任上海建纬律师事务所北京分所创始合伙人等职务。

许亮先生，独立董事，清华大学文学和经济学双学士，哈佛商学院 MBA。现任合一资本创始管理合伙人、光影工场董事长，兼任北京外商投资企业协会副会长，科技部产业化促进会理事，哈佛大学北京校友会副会长，清华企业家协会（TEEC）北京分会副主席，曾任永新视博早期共同创始人，英特尔（中国）公司高级财务分析师、战略项目经理，鼎晖投资从事风险投资工作，永新视博公司执行副总裁、首席财务官，博纳影业集团首席财务官、集团副总裁。

## 2. 基金管理人监事会成员:

刘大伟先生, 监事, 西安交通大学学士, 国防科技大学硕士, 清华大学硕士。现任宜信惠民投资管理(北京)有限公司总裁助理, 曾任北京军区自动化站主任, 北京市天元网络技术有限公司经理助理, 宜信汇才商务顾问(北京)有限公司渠道总监。

耿凯先生, 监事, 清华大学自动化专业工学学士、清华大学自动化专业工学硕士。现任清控资产管理(上海)有限公司总经理, 曾任启迪创业投资管理有限公司投资总监、上海泰蕴投资管理有限公司合伙人和董事总经理。

冯奕先生, 监事, 北京广播学院(现更名为: 中国传媒大学)学士, 清华大学经管学院硕士。现任诺德基金管理有限公司公共事务总监, 曾任清华兴业投资管理有限公司培训部经理、赛尔教育科技发展有限公司培训部总监。

刘静女士, 监事。清华大学本科毕业, 现任职于诺德基金管理有限公司综合管理部, 曾任职于清华校友总会。

## 3. 公司高级管理人员:

潘福祥先生, 董事, 董事长。清华大学学士、硕士, 中国社会科学院金融学博士。历任清华大学经济管理学院院长助理、安徽省国投上海证券总部副总经理和清华兴业投资管理有限公司总经理, 清华大学经济管理学院和国家会计学院客座教授, 诺德基金管理有限公司董事、副总经理、总经理。

胡志伟先生, 董事, 总经理, 南京大学经济学硕士。历任江苏证券有限责任公司投资银行部业务经理, 亚洲控股有限公司投资银行部高级经理, 2005年8月加入诺德基金管理有限公司至今, 先后担任投资研究部行业研究员、基金经理助理、基金经理、投资副总监、投资总监职务。

罗凯先生, 副总经理, 清华大学工商管理硕士。曾任职于江苏省交通产业集团投资发展处。2007年7月加入诺德基金管理有限公司, 先后担任华北区渠道经理、华北区总监、市场总监助理、市场副总监兼专户理财部负责人、市场总监。

陈玮光先生, 督察长, 西安交通大学学士, 中国人民大学硕士, 湖南大学博士。先后任职于永州市地方税务局、中国证券投资者保护基金公司、安徽省宿松县人民政府(挂职), 中国证券业协会和中聚资产管理公司。2016年5月加入诺德基金管理有限公司。

## 4. 本基金基金经理

赵滔滔先生, 本基金基金经理、诺德增强收益债券型证券投资基金基金经理、诺德货币市场基金和诺德天禧债券型证券投资基金。上海财经大学金融学硕士。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, 担任债券交易员, 固定收益研究员等职务。现任本公司固定收益部总监, 具有基金从业资格。

## 5. 投资决策委员会成员

公司总经理胡志伟先生、固定收益部总监赵滔滔先生、投资副总监朱红先生、研究副总监罗世锋先生。6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称: 华夏银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街22号(100005)

办公地址: 北京市东城区建国门内大街22号(100005)

法定代表人: 吴建

成立时间: 1992年10月14日

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 10,685,572,211元人民币

批准设立机关和设立文号: 中国人民银行[银复(1992)391号]

基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字[2005]25号

联系人: 徐昊光

电话: (010) 85238982

传真：（010）85238680

## （二）主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险与合规管理室和运营室4个职能处室。资产托管部共有员工34人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

## （三）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。截至2016年6月末，本公司托管证券投资基金、券商集合计划、银行理财、信托、保险等各类产品合计671只，托管规模16,109.54亿元，实现托管手续费收入3.92亿元。

## 二、基金托管人的内部控制制度说明

### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

风险管理委员会负责华夏银行股份有限公司的风险管理与内部控制工作，总行审计部对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管部内部专门设置了风险与合规管理室，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### （三）内部控制的原则

- 1、合法性原则：必须符合国家及监管部门的法律法规和各项制度并贯穿于托管业务经营管理活动的始终；
- 2、完整性原则：一切业务、管理活动的发生都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部门、岗位和人员；
- 3、及时性原则：托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度；
- 4、审慎性原则：必须实现防范风险、审慎经营，保证基金财产的安全与完整；
- 5、有效性原则：必须根据国家政策、法律及华夏银行经营管理的发展变化进行适时修订；必须保证制度的全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外；
- 6、独立性原则：资产托管部内部专门设置了风险与合规管理室，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### （四）内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理办法、实施细则、岗位职责、业务操作流程等，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；专门设置业务操作区，封闭管理，实施音像监控；指定专人负责受托资产的信息披露工作，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对本基金管理人进行监督的方法和程序

托管人根据《基金法》、《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同的规定，对基金投资范围、投资对象、投资比例、融资比例、基金投资禁止行为、基金资产净值计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、相关信息披露等进行监督。

- 1、基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同规定的行为，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进

行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

2、对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

3、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金销售机构：

##### 1、场外销售机构

###### (1) 直销机构

名称：诺德基金管理有限公司

住所：上海市浦东陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 12 楼

办公地址：上海市浦东陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 12 楼

法定代表人：潘福祥

客户服务电话：400-888-0009 021-68604888

传真：021-68882526

联系人：孟晓君

网址：[www.nuodefund.com](http://www.nuodefund.com)

###### (2) 代销机构

##### 1) 华夏银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：陈秀良客户服务统一咨询电话：95577

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

##### 2) 中国银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客户服务统一咨询电话：95566

网址：<http://www.boc.cn>

##### 3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务统一咨询电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

##### 4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：陈铭铭  
客户服务电话：95559  
网址：www.bankcomm.com

5) 中信银行股份有限公司  
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座  
法定代表人：孔丹  
客服电话：95558  
联系人：丰靖  
电话：010-65557083  
传真：010-65550827  
网址：http://bank.ecitic.com

6) 长江证券股份有限公司  
住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦  
法定代表人：胡运钊  
客户服务热线：4008-888-999 或 95579  
联系人：李良  
电话：027-65799999  
传真：027-85481900  
长江证券长网网址：www.95579.com

7) 国泰君安证券股份有限公司  
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号  
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼  
法定代表人：杨德红  
客户服务电话：95521  
网址：www.gtja.com

8) 平安证券有限责任公司  
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼  
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场群楼8楼  
法定代表人：杨宇翔  
全国免费业务咨询电话：4008816168  
开放式基金业务传真：0755-82400862  
联系电话：4008866338  
网址：http://www.PINGAN.com

9) 海通证券股份有限公司  
注册地址：上海市淮海中路98号  
办公地址：上海市广东路689号  
法定代表人：王开国  
电话：021-23219000  
传真：021-23219100

客服电话：400-8888-001（全国）、021-95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

10) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

联系人：余雅娜

联系电话：0791-6768763

公司网址：<http://www.avicsec.com/>

客服电话：400-8866-567

11) 中泰证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

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

12) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

电话：021-53519888

传真：021-62470244

联系人：张瑾

客服电话：021-962518 或 4008918918（全国）

业务联系电话：021-53519888

公司网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

13) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

联系电话：010-66045608

传真：(010) 66555500

客服电话：010-66045678

天相投顾：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

天相基金网：<https://jijin.txsec.com>

14) 长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

法定代表人：傅毅辉  
公司联系人：卢金文  
电话：0592-5161642  
客服电话：0592-5163588  
公司网址：www.xmzq.cn

15) 华安证券有限责任公司  
注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号  
法定代表人：李工  
邮政编码：230069  
公司联系人：甘霖  
电话：0551-5161821  
传真：0551-5161672  
客服电话：96518(安徽) /4008096518(全国)  
公司网址：www.hazq.com/

16) 中信证券股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层  
办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层  
法定代表人：王东明  
联系人：陈忠  
电话：010-84683893  
传真：010-84865560  
网站：中信金融网 www.ecitic.com

17) 华福证券有限责任公司  
注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层  
办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层  
邮政编码：350003  
法定代表人：黄金琳  
开放式基金业务联系人：张腾  
联系电话：0591-87383623  
开放式基金业务传真：0591-87383610  
统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）  
公司网址：www.hfzq.com.cn

18) 东海证券有限责任公司  
注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼  
办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼  
法定代表人姓名：朱科敏  
基金业务对外联系人姓名：李涛  
联系电话：0519-88157761  
联系传真：0519-88157761



公司网址 <http://www.longone.com.cn>

免费服务热线 400-888-8588

19) 金元证券股份有限公司

注册地址: 海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

邮政编码: 570206

法定代表人: 陆涛

办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

邮政编码: 518048

客服电话: 400-8888-228

联系人: 马贤清

业务联系电话: 0755-83025022

公司网站: [www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

20) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 徐浩明

联系人: 刘晨、李芳芳

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

客户服务电话: 4008888788、10108998

公司网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

21) 信达证券股份有限公司

注册(办公)地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人: 高冠江

联系人: 唐静

联系电话: 010-63081000

传真: 010-63080978

客服电话: 400-800-8899

公司网址: [www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

22) 中信万通证券有限责任公司

法定代表人: 张智河

注册地址: 青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)

办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层  
(266061)

基金业务联系人: 吴忠超

电话: 0532-85022326

传真: 0532-85022605

客户服务电话: 0532-96577

公司网址: [www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

23) 东吴证券股份有限公司

注册地址: 苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 17-21 层

法定代表人: 吴永敏

电话: 0512-65581136

传真: 0512-65588021

联系人: 方晓丹

客户服务电话: 0512-33396288

网址: <http://www.dwzq.com.cn>

24) 兴业证券股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 268 号

邮政编码: 350003

法定代表人: 兰荣

注册资金: 22 亿元人民币

办公地址: 上海市浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层

邮政编码: 200135

客服电话: 400888123

联系人: 谢高得

业务联系电话: 021-38565785

兴业证券公司网站: [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn):

25) 中国银河证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 顾伟国

联系人: 田薇

客服电话: 4008-888-888

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

26) 广州证券有限责任公司

注册地址: 广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

办公地址: 广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

法定代表人: 吴志明

电话: 020-87322668

传真: 020-87325036

联系人: 林洁茹

客户服务电话: 020-961303

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

27) 杭州银行股份有限公司

注册地址: 杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址: 杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人: 马时雍

联系人: 严峻

联系电话：0571-85108195  
传真：0571-85106576  
客户服务电话：400888508 或 0571-96523  
网址：www.hzbank.com.cn

28) 华泰证券股份有限公司  
住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦  
办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦  
法定代表人：吴万善  
电话：025-84457777  
联系人：樊昊  
客服热线：95597  
网址：www.htsc.com.cn

29) 民生证券股份有限公司  
注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层  
办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层  
法定代表人：岳献春  
联系人：赵明  
业务联系电话：010-85127622  
客服电话：400 619 8888  
网址：www.msyzq.com

30) 国联证券股份有限公司  
注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号  
办公地址：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6-8 楼  
法定代表人：雷建辉  
电话：0510-82831662  
客户服务电话：4008885288  
网址：www.glsc.com.cn

31) 中信建投证券股份有限公司  
注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼  
办公地址：北京市朝阳区内大街 188 号  
法定代表人：王常青  
联系电话：4008888108  
联系人：权唐  
中信建投证券客户咨询电话：4008888108  
公司网址：www.csc108.com

32) 瑞银证券有限责任公司  
注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层，100033  
办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层，100033  
法定代表人：刘弘

联系人：牟冲  
联系电话：010-58328112  
客户服务电话：400-887-8827  
网址：www.ubssecurities.com

33) 国元证券股份有限公司  
注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号  
办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号  
法定代表人：凤良志  
联系人：李飞  
联系电话：0551-22057039  
客户电话：400-8888-777  
网址：www.gyzq.com.cn

34) 安信证券股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元  
办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元  
深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层  
法定代表人：牛冠兴  
电话：0755-82825551  
传真：0755-82558355  
统一客服电话：4008001001  
公司网站地址：www.essence.com.cn

35) 国海证券股份有限公司  
注册地址：广西桂林市辅星路 13 号  
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3 楼  
法定代表人：张雅锋  
联系人：牛孟宇  
电话：0755-83709350  
传真：0755-83704850  
客服电话：95563  
网址：<http://www.ghzq.com.cn>

36) 招商证券股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层  
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层  
法定代表人：宫少林  
电话：0755-82943666  
传真：0755-82943636  
客户服务热线：95565  
网址：<http://www.newone.com.cn>

37) 深圳众禄基金销售有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

注册资本：2000 万元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

联系人：张玉静

电话：0755-33227953

传真：0755-33227951

网址：<http://www.zlfund.cn> 及 <http://www.jjmmw.com>

38) 第一创业证券有限责任公司

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路投行大厦 16-20 层

法定代表人：刘学民

电话：0755-25832583

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

39) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：李晓明

电话：0571-28829790，021-60897869

传真：0571-26698533

40) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-1289

公司网站：<http://www.erichfund.com>

41) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-58870011

传真：68596916

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

客服电话：400-700-9665

42) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系电话：021-38602377

传真：021-38509777

联系人：方成

客服电话：400-821-5399

公司网址：<http://www.noah-fund.com>

43) 东北证券股份有限公司

地址：长春市自由大路 1138 号

法人代表：矫正中

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客服电话：4006-000686

公司网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

44) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

电话：023-63786141

传真：023-63786212

联系人：张煜

客服电话：4008096096

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

45) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-888-6661

公司网站：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

46) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：0.51-8686659

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618、95573

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

47) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022/ 021-20835588

网址：licaike.hexun.com

48) 万银财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201

法定代表人：李招弟

电话：010-59393923

传真：010 -59393074

联系人：高晓芳

客服电话：400-808-0069

网址：www.wy-fund.com

49) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

网站：www.ijijin.cn

客服电话：95105885

50) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

联系电话：021-54509998

传真：021-64385308

联系人：潘世友

公司网址：www.1234567.com.cn

客服电话：400-1818-188

51) 联讯证券股份有限公司

住所：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四  
层

办公地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

传真：021-33606760

客服电话：95564

网址：http://www.lxzq.com.cn/

52) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：黄扬录

客户服务电话：4001-022-011

网址: [www.zszq.com](http://www.zszq.com)

53) 华西证券股份有限公司

住所: 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址: 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人: 杨炯洋

联系人: 周志茹

联系人电话: 028-86135991

传真: 028-86150040

网址: <http://www.hx168.com.cn>

54) 上海利得基金销售有限公司

住所: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人: 沈继伟

客户服务电话: 021-50583533

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

55) 申万宏源证券有限公司

地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

客服电话: 95523 或 4008895523

网址: [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

56) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址: 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址: 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人: 冯修敏

客户服务电话: 400-820-2819

网址: <https://tty.chinapnr.com/>

57) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 郭坚

联系人: 宁博宇

联系电话: 021-20665952

客服电话: 4008-219-031

网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

58) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人: 沈伟桦



联系人：程刚  
电话：010-52855713  
客服电话：400-6099-200  
网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

59) 嘉实财富管理有限公司  
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元  
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元  
法定代表人：赵学军  
客户服务电话：400-021-8850  
网址：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

60) 深圳富济财富管理有限公司  
注册地址：深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
法定代表人：齐小贺  
客服电话：0755-83999907  
网址：[www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

61) 上海凯石财富基金销售有限公司  
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室  
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼  
法定代表人：陈继武  
客服电话：4000-178-000  
网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

62) 浙江金观诚财富管理有限公司  
注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室  
办公地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）一楼金观诚财富  
法定代表人：徐黎云  
客服电话：400-068-0058  
网址：<http://www.jincheng-fund.com>

63) 中信期货有限公司  
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层  
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层  
法定代表人：张皓  
客服电话：400-990-8826  
网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

64) 华鑫证券有限责任公司  
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元  
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦第28层A01、B01(b)单元  
法定代表人：俞洋  
客服电话：4001099918

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

65) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人: 肖雯

客服电话: 020-89629066

网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

66) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址: 福建省厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼

办公地址: 福建省厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼

法定代表人: 陈洪生

联系人: 梁云波

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

67) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

法定代表人: 李悦

客服电话: 4007-868-868

网址: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

68) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人: TAN YIK KUAN

客服电话: 400-684-0500

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

69) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

法定代表人: 王伟刚

客服电话: 400-619-9059

网址: [www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

70) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

法定代表人: 蒋煜

客服电话: 400-818-8866

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

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并及时公告。

(2) 场内销售机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位:

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川

财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

如果会员单位有所增加或减少，请以深圳证券交易所的具体规定为准。

（二）注册登记机构：

名称：中国证券登记结算有限责任公司  
住所：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层  
办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号  
法定代表人：金颖  
电话：（010）59378839  
传真：（010）59378907  
联系人：朱立元

（三）律师事务所与经办律师：

名称：上海源泰律师事务所  
住所：上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室  
办公地址：上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室  
负责人：廖海  
联系电话：（021）51150298  
传真：（021）51150398  
经办律师：廖海、刘佳

（四）会计师事务所：

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
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：上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼  
法定代表人：李丹  
电话：（021）23238888  
传真：（021）23238800  
联系人：曹阳  
经办会计师：单峰、曹阳

#### 四、基金份额的分级

（一）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，所募集的基金资产合并运作。

1、基金份额配比

双翼 A、双翼 B 的份额配比原则上不超过 2:1。

本基金募集设立时，双翼 A、双翼 B 的份额配比将不超过 2:1。

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。在双翼 A 的每次开放日，基金管理人将对双翼 A 进行基金份额折算，双翼 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的双翼 A 份额数按折算比例相应增减。为此，在双翼 A 的单个开放日，如果双翼 A 没有赎回或者净赎回份额极小，双翼 A、双翼 B 在该次开放日后的份额配比可能会出现大于 2:1 的情形；如果双翼 A 的净赎回份额较多，双翼 A、双翼 B 在该次开放日后的份额配比可能会出现小于 2:1 的情形。

## 2、双翼 A 的运作

### (1) 收益率

双翼 A 根据《基金合同》的规定获取约定收益，其收益率将在每个开放日设定一次并公告。计算公式为：

双翼 A 的年收益率（单利）=1.3×1 年期银行定期存款利率。

双翼 A 的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位。

在《基金合同》生效日当日，基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率设定双翼 A 的首次年收益率；在双翼 A 的每个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率重新设定双翼 A 的年收益率。

例 1：在本基金《基金合同》生效日，如果 1 年期银行定期存款利率为 2.25%，则双翼 A 的年收益率（单利）为：

双翼 A 的年收益率（单利）=1.3×2.25%=2.93%

基金管理人并不承诺或保证封闭期满时双翼 A 份额持有人的约定应得收益，即如果在封闭期末本基金资产出现极端损失的情况下，双翼 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金损失的风险。

### (2) 开放日

双翼 A 在《基金合同》生效后每满 6 个月开放一次，接受投资者的申购与赎回。当本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，本基金将转换为上市开放式基金（LOF）。届时，双翼 A 的最后一个开放日，即本基金《基金合同》生效后 3 年期届满日前的最后一个开放日，双翼 A 不再接受投资者的申购，只接受投资者的赎回。

双翼 A 的开放日为自《基金合同》生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日。

因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的，开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

双翼 A 的第一次开放日为《基金合同》生效日至 6 个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；第二次开放日为《基金合同》生效之日至 12 个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；以此类推。如，如果本基金《基金合同》于 2011 年 8 月 11 日生效，《基金合同》生效之日起满 6 个月、满 12 个月、满 18 个月的日期分别为 2012 年 2 月 10 日、2012 年 8 月 10 日、2013 年 2 月 10 日，以此类推。假设 2012 年 2 月 10 日为非工作日，在其之前的最后一个工作日为 2012 年 2 月 9 日，则第一次开放日为 2012 年 2 月 9 日。其他各个开放日的计算类同。

### (3) 基金份额折算

本基金《基金合同》生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日，基金管理人将对双翼 A 进行基金份额折算，双翼 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的双翼 A 份额数按折算比例相应增减。

双翼 A 的基金份额折算基准日与开放日为同个工作日。但在双翼 A 的最后一个开放日，即本基金《基金合同》生效后 3 年期届满日前的最后一个开放日，不再进行双翼 A 的基金份额折算。

双翼 A 的基金份额折算具体见本招募说明书第九部分以及基金管理人届时发布的相关公告。

### (4) 规模限制

本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，双翼 A 的份额余额原则上不得超过 2 倍双翼 B 的份额余额。具体规模限制及其控制措施见本《招募说明书》、《发售公告》以及基金管理人发布的其他相关公告。

## 3、双翼 B 的运作

### (1) 双翼 B 封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。

双翼 B 的封闭期为自《基金合同》生效之日起至 3 年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

(2) 本基金《基金合同》生效后 3 个月内，在符合基金上市交易条件下，双翼 B 将申请在深圳证券交易所上市交易。

(3) 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。

#### 4、基金份额发售

双翼 A、双翼 B 将分别通过各自销售机构的销售网点独立进行公开发售。

#### 5、基金份额净值计算

本基金的基金份额净值计算公式如下：

$T$  日基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日基金份额的余额数量

本基金《基金合同》生效之日起 3 年内， $T$  日基金份额的余额数量为双翼 A 和双翼 B 的份额总额；本基金《基金合同》生效后 3 年期满并转为上市开放式基金（LOF）后， $T$  日基金份额的余额数量为该 LOF 基金的份额总额。

本基金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。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### 6、双翼 A 和双翼 B 的基金份额净值计算

本基金《基金合同》生效后，在双翼 A 的开放日计算双翼 A 的基金份额净值；在双翼 B 的封闭期届满日分别计算并公告双翼 A 和双翼 B 的基金份额净值。

##### (1) 双翼 A 的基金份额净值计算

本基金《基金合同》生效后，截止双翼 A 的某一开放日或者双翼 B 的封闭期届满日（ $T$  日），设为自双翼 A 上一次开放日（如  $T$  日为第一次开放日，则为基金成立日）至  $T$  日的运作天数， $A$  为  $T$  日闭市后的基金资产净值， $B$  为  $T$  日双翼 A 的份额余额， $C$  为  $T$  日双翼 B 的份额余额， $r$  为在双翼 A 上一次开放日（如  $T$  日为第一次开放日，则为基金成立日）设定的双翼 A 的年收益率。

1) 如果  $T$  日闭市后的基金资产净值大于或等于“1.00 元乘以  $T$  日双翼 A 的份额余额加上  $T$  日全部双翼 A 份额应计收益之和”，则：

“ $T$  日全部双翼 A 份额应计收益”计算公式如下：

$T$  日全部双翼 A 份额应计收益 = （下同）

以上各式中，运作当年实际天数指双翼 A 上一次开放日（如  $T$  日之前双翼 A 尚未进行开放，则为基金成立日）所在年度的实际天数，下同。

2) 如果  $T$  日闭市后的基金资产净值小于“1.00 元乘以  $T$  日双翼 A 的份额余额加上  $T$  日全部双翼 A 份额应计收益之和”，则：

##### (2) 双翼 B 的基金份额净值计算

设为双翼 B 封闭期届满日（ $T$  日）双翼 B 的基金份额净值，双翼 B 的基金份额净值计算公式如下：

双翼 A、双翼 B 的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。

$T$  日的双翼 A 和双翼 B 基金份额净值在当天收市后计算，并在  $T+1$  日内公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

例 2：本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，设自双翼 A 上一次开放日起的运作天数为 180 天，基金运作当年的实际天数为 365 天，基金资产净值为 35 亿元，双翼 A、双翼 B 的份额余额分别为 20 亿和 10 亿份，双翼 A 上一次开放日设定的双翼 A 年收益率为 2.93%。则双翼 A、双翼 B 的基金份额净值计算如下：

双翼 A 的基金份额净值 = 1.014（元）

双翼 B 的基金份额净值=1.472（元）

#### 7、双翼 A 和双翼 B 的基金份额参考净值计算

本基金《基金合同》生效后 3 年期内，基金管理人在计算基金资产净值的基础上，采用“虚拟清算”原则分别计算并公告双翼 A 和双翼 B 的基金份额参考净值，其中，双翼 A 的基金份额参考净值计算日不包括双翼 A 的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

##### （1）双翼 A 的基金份额参考净值计算

本基金《基金合同》生效后 3 年期内，在双翼 A 的非开放日（t 日），设为自双翼 A 上一次开放日（如 t 日之前双翼 A 尚未进行开放，则为基金成立日）至 t 日的运作天数，为 t 日闭市后的基金资产净值，为 t 日双翼 A 的份额余额，为 t 日双翼 B 的份额余额，为 t 日双翼 A 的基金份额参考净值，r 为在双翼 A 上一次开放日（如 t 日之前双翼 A 尚未进行开放，则为基金成立日）设定的双翼 A 的年收益率。

（1）如果 t 日闭市后的基金资产净值大于或等于“1.00 元乘以 t 日双翼 A 的份额余额加上 t 日全部双翼 A 份额应计收益之和”，则：

“t 日全部双翼 A 份额应计收益”计算公式如下：

t 日全部双翼 A 份额应计收益=（下同）。

以上各式中，运作当年实际天数指双翼 A 上一次开放日（如 t 日之前双翼 A 尚未进行开放，则为基金成立日）所在年度的实际天数，下同。

（2）如果 t 日闭市后的基金资产净值小于“1.00 元乘以 t 日双翼 A 的份额余额加上 t 日全部双翼 A 份额应计收益之和”，则：

#### 2、双翼 B 的基金份额参考净值计算

设为 t 日双翼 B 的基金份额参考净值，双翼 B 的基金份额参考净值计算公式如下：

上式中，在本基金《基金合同》生效后 3 年内的双翼 A 非开放日，为双翼 A 的基金份额参考净值；在双翼 A 的开放日，为双翼 A 的基金份额净值。

双翼 A、双翼 B 的基金份额参考净值的计算，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。

例 3. 本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，设自双翼 A 上一次开放日起的运作天数为 60 天，基金运作当年的实际天数为 365 天，基金资产净值为 33 亿元，双翼 A、双翼 B 的份额余额分别为 20 亿和 10 亿份，双翼 A 上一次开放日设定的双翼 A 年收益率为 2.93%。则双翼 A、双翼 B 的基金份额参考净值计算如下：

双翼 A 的基金份额参考净值=1.005（元）

双翼 B 的基金份额参考净值=1.290（元）

#### 8、双翼 A 与双翼 B 基金份额净值的公告

本基金《基金合同》生效后 3 年期内，在双翼 A 的非开放日，本基金将公告双翼 A 和双翼 B 的基金份额参考净值；在双翼 A 的开放日，本基金将公告双翼 A 的基金份额净值和双翼 B 的基金份额参考净值。

在双翼 B 的 3 年封闭期届满日，本基金将公告双翼 A 和双翼 B 的基金份额净值。

##### （二）《基金合同》生效后 3 年期届满时的基金份额转换

本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，本基金将按照《基金合同》约定转换为上市开放式基金（LOF），双翼 A、双翼 B 的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额，并办理基金的申购与赎回业务。

本基金《基金合同》生效后 3 年期届满时的基金转换见本招募说明书第十六部分及基金管理人届时发布的相关公告。

## 五、基金的名称

基金名称为诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）

## 六、基金的类型

基金类型为债券型基金，运作方式为契约型。

## 七、双翼 A 的基金份额折算

本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，双翼 A 将按以下规则进行基金份额折算。

### （一）折算基准日

本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，双翼 A 的基金份额折算基准日为自《基金合同》生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日。

双翼 A 的基金份额折算基准日与其开放日为同个工作日，除双翼 A 的最后一个开放日，即本基金《基金合同》生效后 3 年期届满日前的最后一个开放日。基金份额折算基准日的具体计算见本招募说明书第六部分中“双翼 A 的运作”的相关内容。

### （二）折算对象

基金份额折算基准日登记在册的双翼 A 所有份额。

### （三）折算频率

自《基金合同》生效之日起每满 6 个月折算一次。

### （四）折算方式

折算日日终，双翼 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，折算后，基金份额持有人持有的双翼 A 的份额数按照折算比例相应增减。

双翼 A 的基金份额折算公式如下：

双翼 A 的折算比例 = 折算日折算前双翼 A 的基金份额净值 / 1.000

双翼 A 经折算后的份额数 = 折算前双翼 A 的份额数 × 双翼 A 的折算比例

双翼 A 经折算后的份额数采用截位方式保留到小数点后 2 位，由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前双翼 A 的基金份额净值、双翼 A 的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

### （五）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双翼 B 的上市交易等业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### （六）基金份额折算的公告

1、基金份额折算方案须迟于实施日前 2 日在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

2、基金份额折算结束后，基金管理人应在 2 日内在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

## 八、基金转型后的基金转换

### （一）、基金转型后的基金存续形式

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），基金名称变更为“诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）”。双翼 A、双翼 B 的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额，并办理基金的申购与赎回业务。

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金份额于 2015 年 3 月 20 日在深圳证券交易所上市交易。

### （二）基金转型时双翼 A 的处理方式

本基金《基金合同》生效后 3 年期届满，基金份额持有人可选择将其持有的双翼 A 份额在最后一个双翼 A 的开放日赎回、或是在届满日转入“诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）”。投资者不选择的，其持有的双翼 A 份额于届满日将被默认为转入“诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）”份额。

本基金《基金合同》生效后 3 年期届满日为自《基金合同》生效之日后 3 年的对应日。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。《基金合同》生效后 3 年期届满日与双翼 B 的封闭期届满日相同。

本基金《基金合同》生效后 3 年期届满日前，基金管理人将提前公告并提示双翼 A 的基金份额持有人作出选择申请，

双翼 A 的基金份额持有人可在届时公告规定的时间内按照公告规定的方式作出选择申请。

### （三）基金转型时的份额转换规则

#### 1、份额转换基准日

本基金《基金合同》生效后 3 年期届满日，即本基金《基金合同》生效之日起 3 年后的对应日，如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

因不可抗力或其他情形致使基金无法按时进行基金转型后的份额转换，份额转换基准日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

#### 2、份额转换方式

在份额转换基准日，本基金转换成上市开放式基金（LOF）后的基金份额净值调整为 1.000 元。

在份额转换基准日日终，以份额转换后 1.000 元的基金份额净值为基准，双翼 A、双翼 B 按照各自的基金份额净值转换成上市开放式基金（LOF）份额。

份额转换计算公式：

双翼 A 份额（或双翼 B 份额）的转换比率=份额转换基准日双翼 A（或双翼 B）的基金份额净值/1.000

双翼 A（或双翼 B）基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金（LOF）份额=基金份额持有人持有的转换前双翼 A（或双翼 B）的份额数×双翼 A 份额（或双翼 B 份额）的转换比率

在进行份额转换时，双翼 A、双翼 B 的场外份额将转换成上市开放式基金（LOF）场外份额，且均登记在注册登记系统下；双翼 B 的场内份额将转换成上市开放式基金（LOF）场内份额，仍登记在证券登记结算系统下。

在实施基金份额转换时，双翼 A 份额（或双翼 B 份额）的转换比率、双翼 A（或双翼 B）基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金（LOF）份额的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 3、份额转换后的基金运作

双翼 A、双翼 B 的份额全部转换为上市开放式基金（LOF）份额之日起 30 日内，本基金将上市交易，并接受场外与场内申购和赎回。份额转换后本基金上市交易、开始办理申购与赎回的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 4、份额转换的公告

（1）本基金《基金合同》生效后 3 年期届满时，本基金将转换为上市开放式基金（LOF），基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金转换的相关事宜进行公告，并报中国证监会备案；

（2）在本基金《基金合同》生效后 3 年期届满日前 30 个工作日，基金管理人将就本基金进行基金转换的相关事宜进行提示性公告。

（3）双翼 A、双翼 B 进行份额转换结束后，基金管理人应在 2 日内在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

### （四）基金转型后基金的投资管理

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，本基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。

### 九、基金的投资目标

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。

### 十、基金的投资方向

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。

## 十一、基金的投资策略

本基金将通过研究分析国内外宏观经济发展形势、政府的政策导向和市场资金供求关系，形成对利率和债券类产品风险溢价走势的合理预期，并在此基础上通过对各种债券品种进行相对价值分析，综合考虑收益率、流动性、信用风险和对利率变化的敏感性等因素，主动构建和调整投资组合，在获得稳定的息票收益的基础上，争取获得资本利得收益，同时使债券组合保持对利率波动的适度敏感性，从而达到控制投资风险，长期稳健地获得债券投资收益的目的。

### 1、资产配置策略

本基金为债券型基金，除了可以全面投资各类债券资产之外，还可参与回购市场的投资以及在预期收益高于预期风险的情况下参与一级市场新股申购和增发，但不直接从二级市场买入股票或权证，对股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的20%。在以上大类资产配置约束的基础上，本基金将通过定性和定量分析相结合，自上而下的实施动态化的整体资产配置策略，有效优化资产配置，在严格控制基金净值下行波动风险的前提下，实现基金投资组合风险和收益的最优配比。

### 2、债券投资策略

根据本基金资产总体配置计划，债券资产投资组合的构建将通过“自上而下”的过程，即首先根据对国内外经济形势的预测，分析市场投资环境的变化趋势，重点关注利率趋势变化；其次，在判断利率变动趋势的同时，全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、债券市场政策趋势、市场资金供求情况等因素，对利率走势形成合理预期。然后，在此基础上本基金将使用“自下而上”的投资策略，考虑债券的信用等级、期限、品种、流动性、交易市场等因素，依据收益率曲线、久期、凸性等指标和相对价值分析研究建立以严格控制久期、控制个券风险暴露度和控制信用风险暴露度为核心的由不同类型、不同期限债券品种构成的债券资产投资组合，并动态实施对投资组合的管理调整，以获取超出比较基准的长期稳定回报。

#### (1) 目标久期配置策略

利率风险是债券投资最主要的损益风险来源之一，而久期是衡量债券利率风险的核心指标。本基金将通过对宏观经济变量（包括国内生产总值、财政收支、价格指数和汇率等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策和汇率政策等）的深入研究分析，预测未来的利率变化趋势，通过情景分析模拟利率未来走势的各种情况，并最终结合风险承受能力和收益目标来确定债券投资组合的目标久期。

本基金将根据对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的目标久期。在预期利率处于上升通道时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险；在预期利率处于下降通道时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益。

#### (2) 期限结构配置策略

在所确定的目标久期配置策略下，本基金将通过对收益率曲线的研究，预测和分析收益率曲线陡峭度可能发生的变化，并据此确定和调整积极调整债券组合期限结构，适时采取子弹型、哑铃型或阶梯型等策略，进一步优化组合配置，力争获取更好的投资总收益。

#### (3) 个券选择策略

在确定本基金债券组合的期限结构后，本基金将研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，对不同类型债券产品进行相对价值分析，包括对票息及付息频率、信用风险、隐含期权、债券条款、税赋水平、市场资金结构和流动性等因素进行分析，判断个券的投资价值，选取风险收益相匹配的券种构建投资组合，以获取不同债券类属之间及不同个券间利差变化所带来的投资收益。在具体进行相对价值分析时，本基金将考虑多种策略，包括利差交易、息差策略、骑乘收益率曲线等。

#### (4) 信用债券投资策略

本基金将根据债券市场历史统计来判断信用利差的合理性和利差曲线的未来走势，确定信用债总体的投资比例。通过对个券投资价值的深入研究，选取风险收益相匹配的券种构建投资组合，以获取不同信用评级债券之间及相同信用评级不同个券间利差变化所带来的投资收益。根据宏观经济运行情况、行业发展周期、公司财务状况、盈利水平和内部治理结构来系统评估信用风险，有效管理债券投资组合的整体信用风险。

#### (5) 可转换债券投资策略

可转换债券兼具股性和债性的双重特征，其内在价值主要取决于其股权价值、债券价值和转换期权价值。同时，由于市场的流动性因素影响，可转换债券的市场交易价格相对于其内在价值会存在不同程度的溢价。本基金将通过可对转换债券内在价值的评估，选择投资价值相对低估的可转换债券。

本基金将借助基金管理人股票分析团队的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，包括所处行业的竞争情况、公司的盈利模式和成长性等，并参考同类公司的估值水平，形成对基础股票的价值评估和股价波动性变化的趋势，从而判断可转换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率、派息频率及信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；根据可转债换股条款，采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，确定可转换债券的内在价值，并根据可转换债券的市场溢价进行相对价值分析，进行可转换债券的投资。

#### (6) 套利交易策略

本基金在法律法规和监管机构许可的前提下，积极合理运用以下套利交易策略：

1) 跨市场套利：同一债券品种在银行间市场和交易所市场、同期限同信用评级品种在一、二级市场由于市场交易方式、投资者结构或市场流动性的不同而可能出现收益率的差异。本基金将依据内部固定收益模型，推理套利充分可行的基础上，寻找合适交易时点，进行跨市场套利。

2) 息差交易套利：在合理控制债券组合流动性风险和信用风险的前提下，假如回购资金成本低于债券收益率且市场处于平稳状态时，本基金可以通过质押组合中的债券，融入资金并买入债券，以便实现适当放大债券组合规模和增加获利的套利目标。

3) 回购套利：本基金在遵守银行间市场和交易所市场相关回购规定的前提下，根据不同市场间的运行规律和风险特征，进行回购跨市场套利和不同回购期限之间的套利等。

#### 3、非债券产品投资策略

本基金对非债券产品的直接投资首选在一级市场上的新股申购（含增发），本基金将对新股的基本面进行分析，包括所处行业的竞争情况、公司的盈利模式和成长性等，并参考同类公司的估值水平，形成对股票的价值评估，从而判断一、二级市场价差的可能大小，并根据资金成本、新股的中签率及上市后股价涨幅的统计，制定新股申购策略。在新发股票获准上市后，本基金将根据对股票内在投资价值的判断，结合股票市场环境的分析，择机卖出。

对于因可转债转股等所得到的股票及持股期间内所发生的送股、配股和权证等，本基金将结合深入的公司调研和严格审慎的基本面与市场面分析，评估标的的内在价值，在其价值被高估时，选择适当的时机卖出。

## 十二、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中国债券总指数。

## 十三、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金成立后的3年内，本基金经过基金份额分级后，双翼A为低风险、预期收益相对稳定的基金份额；双翼B为风险较高、预期收益较高的基金份额。

## 十四、基金的投资组合报告

本投资组合报告内容节选自《诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）季度报告（2016第2季度）》，报告截至日期为2016年6月30日

。

### 1 报告期末基金资产组合情况

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 332,986,363.40 47.17

其中：债券 332,986,363.40 47.17

资产支持证券 --  
 3 贵金属投资 --  
 4 金融衍生品投资 --  
 5 买入返售金融资产 150,900,000.00 21.38  
 其中：买断式回购的买入返售金融资产 --  
 6 银行存款和结算备付金合计 215,461,363.05 30.52  
 7 其他资产 6,604,296.52 0.94  
 8 合计 705,952,022.97 100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合  
 本基金本报告期末未持有股票。

3 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  
 本基金本报告期末未持有股票。

4 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 24,875,000.00 5.21  
 2 央行票据 --  
 3 金融债券 --  
 其中：政策性金融债 --  
 4 企业债券 127,801,363.40 26.79  
 5 企业短期融资券 170,255,000.00 35.69  
 6 中期票据 10,055,000.00 2.11  
 7 可转债 --  
 8 同业存单 --  
 9 其他 --  
 10 合计 332,986,363.40 69.81

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 112351 16步高01 300,000.00 29,961,000.00 6.28  
 2 020112 16贴债14 250,000.00 24,875,000.00 5.21  
 3 041551032 15大族CP001 200,000.00 20,186,000.00 4.23  
 4 041662010 16江宁水CP001 200,000.00 20,028,000.00 4.20  
 5 011699292 16广物控股SCP001 200,000.00 20,028,000.00 4.20

6 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资产支持证券投资明细  
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
 本基金未投资贵金属。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金未投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金本报告期内投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 62,944.11

2 应收证券清算款 1,299,531.55

3 应收股利 -

4 应收利息 5,241,820.86

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 6,604,296.52

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 十五、基金的业绩

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### (1) 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

2012年2月16日至2012年12月31日 7.85% 0.11% -0.52% 0.07% 8.37% 0.04%

2013年1月1日至2013年12月31日 3.05% 0.15% -5.28% 0.11% 8.33% 0.04%

2014年1月1日至2014年12月31日 12.23% 0.17% 7.48% 0.15% 4.75% 0.02%

2015年1月1日至2015年12月31日 0.19% 0.73% 4.51% 0.12% -4.32% 0.61%

2016年1月1日至2016年6月30日 1.31% 0.06% -0.44% 0.09% 1.75% -0.03%

### (2) 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2012年2月16日至2016年6月30日）

注：“本基金成立于2012年2月16日，图示时间段为2012年2月16日至2016年6月30日。

本基金建仓期间自2012年2月16日至2012年8月15日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。”

## 十六、费用概览

### 一、与基金运作有关的费用

#### (一) 与基金运作有关的费用列示

- 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、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 5、《基金合同》生效以后与基金相关的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、《基金合同》生效以后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的上市交易费用；
- 10、按照国家有关法律法规和《基金合同》约定，可以在基金财产中列入的其他费用。

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.70%年费率计提。

本基金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

基金管理费每日计提，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、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 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

基金托管费每日计提，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、公休日等，支付日期顺延。

4、本条第（一）款第 4 至第 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。

## 二、与基金销售有关的费用

### （一）《基金合同》生效之日起 3 年内基金的申购与赎回费用

#### 1、双翼 A 的申购与赎回费用

（1）双翼 A 不收取申购费用

（2）双翼 A 的赎回费率

以《基金合同》生效后每满 6 个月为双翼 A 的一个开放周期，持有期限为一个开放周期的，双翼 A 的赎回费率为 0.1%；持有期限为一个以上开放周期（不含）的，双翼 A 的赎回费为 0。双翼 A 的赎回费归入基金财产的比例为赎回费总额的 100%。

基金管理人可以在法律法规和《基金合同》规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 日前在中国证监会指定的媒体上刊登公告。

#### 2、双翼 B 的申购与赎回费用

本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，双翼 B 封闭运作并上市交易，封闭期内不接受申购与赎回。

双翼 B 的封闭期为自《基金合同》生效之日起至 3 年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

### （二）《基金合同》生效后 3 年期届满并进行基金转换后的申购与赎回费用

（1）本基金不收取申购费用。

（2）赎回费率

本基金的场内赎回费率为固定 0.1%。

本基金的场外赎回费率如下表所示：

持有期限 赎回费率

180 天以内 0.1%

180 天以上（含 180 天） 0

(3) 本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，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赎回费总额的 25%。

(4) 本基金由原有双翼 A、双翼 B 份额转入的场外份额不收取赎回费；由原有双翼 A、双翼 B 份额转入的场内份额赎回费率为固定 0.1%。

(5) 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 个工作日在指定媒体公告。

### 三、其他费用

本基金的其他费用依照相关法律法规执行。

### 十七、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、在“重要提示”部分修改了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据和净值表现的截止日期。
- 2、在“三、基金管理人”部分对基金管理人概况、主要人员情况进行了更新。
- 3、在“四、基金托管人”部分对基金托管人情况进行了更新。
- 4、在“五、相关服务机构”部分对代销机构信息进行了更新。
- 5、在“十七、基金的投资”中，根据本基金实际运作情况更新了投资组合报告的内容。
- 6、在“十八、基金的业绩”中，根据基金的实际运作情况，对本基金的业绩进行了说明。
- 7、在“三十、其他应披露事项”中，对披露的重要定期报告等重大公告事项予以说明。

诺德基金管理有限公司

二〇一六年九月二十六日