# 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

## 一、重要声明与提示

诸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，诸德双翼分级债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）管理人诸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》以及诸德基金管理有限公司网站（www.nuodefund.com）上的《诸德双翼分级债券型证券投资基金招募说明书》。

## 二、基金概览

1、基金名称：诸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：诸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：诸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诸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诸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、本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 | 郭有剑 | 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：诸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月诸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月加入诸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月起担任诸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、诸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。
诸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，诸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；基金管理人对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《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》及有关法律规定监督基金托管人，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；
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》及有关法律规定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和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》规定的其他权利。
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，如发现基金管理人有违反《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》规定的其他权利。
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；如果基金管理人有未执行《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，应当出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