诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）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:2015年3月20日
公告日期:2015年3月17日

一、重要声明与提示

《诺德双翼债券型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》(以下简称"本公告书")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>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,诺德双翼债券型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")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书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、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。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2014年9月27日登载于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和诺德基金管理有限公司网站(www.nuodefund.com)的本基金招募说明书。

二、基金概览

1、基金名称:诺德双翼债券型证券投资基金(LOF)
2、基金类型:债券型
3、基金运作方式:契约型开放式
4、基金存续期限:不定期
5、基金份额总额:截至2015年3月13日,本基金的基金份额总额为 201,044,202.21份。
6、基金份额净值:截至2015年3月13日,本基金的基金份额净值为 1.006元。
7、本次上市交易的基金份额交易代码:165705
8、本次上市交易的基金份额简称:诺德双翼
9、本次上市交易的基金份额总额: 149,006,343.00 份(截至2015年3月13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:2015年3月20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
14、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的历史、转型结果、日常申赎、上市交易和跨系统转托管

(一)本基金的历史

诺德双翼债券型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")由诺德双翼分级债券型证券投资基金分级运作届满转型而成。

诺德双翼分级债券型证券投资基金经中国证监会2011年10月24日证监许可【2011】1691号文核准募集。

诺德双翼分级债券型证券投资基金基金管理人为诺德基金管理有限公司(以下简称"基金管理人"),基金托管人为华夏银行股份有限公司。基金管理人于2012年2月16日获得中国证监会书面确认,《诺德双翼分级债券型证券投资基金基金合同》生效,基金募集规模403,706,862.48份。

(二)本基金的转型

根据《诺德双翼分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")的有关规定,《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,即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)"。

基金管理人于2015年1月13日和2015年2月11日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站上披露了《诺德双翼分级债券型证券投资基金分级运作期届满与基金份额转换的公告》和《诺德双翼分级债券型证券投资基金之双翼A份额开放赎回业务公告》。

本基金管理人于2015年2月16日对诺德双翼分级债券型证券投资基金进行了3年期届满到期后的基金转型工作。经本基金管理人计算并经本基金基金托管人华夏银行股份有限公司确认,基金份额转换日(2015年2月16日)转型前诺德双翼分级债券型证券投资基金之双翼A份额(以下简称"双翼A")的基金份额净值为1.020元,本基金管理人按照1.019767123:1的转换比例进行了折算,折算后基金份额净值为1.000,折算后的原双翼A基金份额总额由47,502,933.47份调整为48,441,929.8份;转型前诺德双翼分级债券型证券投资基金之双翼B份额(以下简称"双翼B")的基金份额净值为1.264元,本基金管理人按照1.264188151:1的转换比例进行了折算,折算后基金份额净值为1.000,折算后的原双翼B的基金份额由134,575,806.41份调整为170,129,139.30份。基金份额总额与持有人持有的基金份额数额将发生调整,份额折算对持有人的权益无实质性影响。

基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请并于2015年2月25日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、基金管理人网站及深圳证券交易所网站发布了《诺德双翼分级债券型证券投资基金基金份额转换结果公告》。

(三)本基金的日常申购、赎回

本基金管理人自2015年3月9日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。具体业务办理规则请见相关公告。

(四)本基金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【2015】94号
2、上市交易日期:2015年3月20日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4、场内简称:诺德双翼
5、交易代码:165705
6、本次上市交易份额:149,006,343.00份(截至2015年3月13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债券型证券投资基金(LOF)的基金份额净值,并在深交所行情发布系统揭示。
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。

(五)本基金转托管的主要内容

为了保证基金份额持有人的利益,本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请,为基金份额持有人开通了转托管业务的办理事宜。

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2015年3月13日,本基金的场内基金份额持有人总户数为850户,平均每户持有的场内基金份额为175,301.58份,其中个人基金份额持有人总户数为799户,平均每户持有的场内基金份额为11,140.22份,机构基金份额持有人总户数为51户,平均每户持有的场内基金份额为2,747,162.90份;本基金的场外基金份额持有人总户数为394户,平均每户持有的场外基金份额为132,075.78份,其中个人基金份额持有人总户数为390户,平均每户持有的场外基金份额为15,241.17份,机构基金份额持有人总户数为4户,平均每户持有的场外基金份额为11,523,451.12份。

(二)持有人结构

截至2015年3月13日,场内基金份额持有人结构如下:

场内机构投资者持有的本基金的场内基金份额为 140,105,308.00份,占比94.00 %;场内个人投资者持有的本基金的场内基金份额为8,901,035.00份,占比 6.00 %。

场外机构投资者持有的本基金的场外基金份额为 46,093,804.48份,占比88.58 %;场外个人投资者持有的本基金的场外基金份额为5,944,054.73份,占比 11.42 %。

(三)基金场内份额前十名持有人情况(截至2015年3月13日)

序号	持有人名称(全称)	证券帐户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	北京国际信托有限公司	0510470058	92,632,673.00	62.17%
2	全国社保基金二零九组合	0899051598	8,406,974.00	5.64%
3	中欧盛世资本-广发银行-中欧盛世-利可1号资产管理计划	0899063721	7,158,214.00	4.80%
4	中欧盛世资本-广发银行-中欧盛世-利可4号资产管理计划	0899065259	4,940,389.00	3.32%
5	中国光大银行股份有限公司金业年金计划-中国光大银行股份有限	0899054074	3,758,811.00	2.52%
6	中欧盛世资本-广发银行-中欧盛世-利可2号资产管理计划	0899064143	3,476,835.00	2.33%
7	中欧盛世资本-广发银行-中欧盛世-利可3号资产管理计划	0899064379	3,301,794.00	2.22%
8	深圳市水务(集团)有限公司金业年金计划-招商银行股份有限公	0899050929	1,896,282.00	1.27%
9	杨海	0136369887	1,769,863.00	1.19%
10	中国信达资产管理股份有限公司金业年金计划-中信银行股份有限	0899057444	1,036,508.00	0.70%
合计			128,378,343.00	86.16%

(三)截至2015年3月13日,基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况 本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为0.00份,占该基金总份额的比例为0.00%。其中,本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0.00份,该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0.00份。

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、名称:诺德基金管理有限公司
2、法定代表人:杨忆风
3、总经理:潘福祥
4、注册资本:1 亿元人民币
5、注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1233 号汇亚大厦12 层
6、设立批准文号:证监基金字[2006]88号
7、工商登记注册的法人营业执照文号:310000400468854
8、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)。
9、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%

10、内部组织结构及职能: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。

11、人员情况:截至2015年3月13日,公司共有员工67人,其中33人具有硕士及以上学历,占员工总数49%,拥有本科及以上学历的员工共63人,占员工总数的94%。

12、信息披露负责人及咨询电话:张欣 021-68879999

13、基金管理业务情况:诺德价值优势股票型证券投资基金、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、诺德成长优势股票型证券投资基金、诺德中小盘股票型证券投资基金、诺德优选30股票型证券投资基金、诺德双翼分级债券型证券投资基金、诺德周期策略股票型证券投资基金、诺德深证300指数分级证券投资基金。

14、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。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。赵滔滔先生具有基金从业资格。

(二)基金托管人

1、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:8,904,643,509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

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30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。截至2014年6月末,已托管长城货币市场证券投资基金、国联安德盛精选股票证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、诺安优收益债券型证券投资基金、益民红利成长混合型证券投资基金、东吴行业轮动股票型证券投资基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金、诺德双翼分级债券型证券投资基金、浙商沪深300指数分级证券投资基金、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证380交易型开放式指数证券投资基金及其它受托资产产品,托管各类资产规模9703.56亿元。

(三)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

(四)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

(五)会计师事务所:
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
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
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:郁豪伟
经办会计师:单峰 俞伟敏

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要请见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。

(二)基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表
本基金2015年3月13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	2015年3月13日
资 产:	
银行存款	2,557,038.96
结算备付金	5,784,910.44
存出保证金	95,239.22
交易性金融资产	310,889,188.30
其中:股票投资	
基金投资	
债券投资	310,889,188.30
资产支持证券投资	
贵金属投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	5,000,000.00
应收证券清算款	2,002,433.47
应收利息	5,523,962.94
应收股利	
应收申购款	103,998.00
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	331,956,771.33
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	126,205,947.80
应付证券清算款	
应付赎回款	2,279,177.90
应付管理人报酬	53,625.84
应付托管费	15,321.67
应付销售服务费	30,643.35
应付交易费用	39,199.85
应交税费	425,592.78
应付利息	43,279.51
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	562,501.67
负债合计	129,655,290.37
所有者权益:	
实收基金	163,339,193.28
未分配利润	38,962,287.68
所有者权益合计	202,301,480.96
负债和所有者权益总计	331,956,771.33

八、基金投资组合

截止2015年3月13日,诺德双翼债券型证券投资基金(LOF)的投资组合如下:

(一)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	310,889,188.30	93.65
	其中:债券	310,889,188.30	93.65
	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	5,000,000.00	1.51
	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	8,341,949.40	2.51
7	其他各项资产	7,725,633.63	2.33
8	合计	331,956,771.33	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期未未持有股票。

(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
本基金本报告期未未持有股票。

(四)报告期末按券种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	24,215,250.50	11.97
2	央行票据		
3	金融债券	9,804,000.00	4.85
	其中:政策性金融债	9,804,000.00	4.85
4	企业债券	238,252,994.40	117.77
5	企业短期融资券		
6	中期票据		
7	可转债	38,616,943.40	19.09
8	其他		
9	合计	310,889,188.30	153.68

(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	126019	09长虹债	141,660	13,970,509.20	6.91
2	010303	03国债(3)	121,170	12,135,175.50	6.00
3	010107	21国债(7)	100,000	10,625,000.00	5.25
4	112045	11宗申债	100,000	10,500,000.00	5.19
5	1380320	13老岩汇金债	100,000	10,487,000.00	5.18

(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
本基金本报告期末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序的前五名贵金属投资明细
本基金未投资贵金属。

(八)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。

(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金未投资股指期货。

(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金未投资国债期货。

(十一)投资组合报告附注

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。

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。

3、截止2015年3月13日其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	95,239.22
2	应收证券清算款	2,002,433.47
3	应收股利	
4	应收利息	5,523,962.94
5	应收申购款	103,998.00
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	7,725,633.63

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	125089	深机转债	46,992	6,598,146.72	3.26
2	113007	吉视转债	41,000	5,764,600.00	2.85
3	128006	长青转债	38,065	5,163,479.19	2.55
4	110023	民生转债	20,000	2,758,400.00	1.36
5	128005	齐翔转债	10,000	1,439,320.00	0.71

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期未未持有股票。

九、重大事件揭示

本基金自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

(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、证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金份额持有人权益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

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,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。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,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、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,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。

十二、备查文件目录

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所,在办公时间内可供免费查阅。

(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

诺德基金管理有限公司
2015年3月17日

附件:基金合同摘要

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)在基金管理人更换时,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《基法法》、《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