诺德双翼分级债券型证券投资基金招募说明书

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

【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。

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守职责、诚实信用、勤勉尽责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。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定以及《诺德双翼分级债券型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了诺德双翼分级债券型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的《基金合同》编写，并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依《基金合同》取得基金份额，即成为基金份额持有人和《基金合同》的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受，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。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指诺德双翼分级债券型证券投资基金；
《基金合同》：	指《诺德双翼分级债券型证券投资基金基金合同》及对该《基金合同》的任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《诺德双翼分级债券型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
发售公告：	指《诺德双翼分级债券型证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议	指《诺德双翼分级债券型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《反洗钱法》	指2006年10月31日经第十届全国人民代表大会常务委员会第二十四次会议通过，自2007年1月1日起实施的《中华人民共和国反洗钱法》及颁布机关对其不时作出的修订；
《销售办法》：	指2004年6月25日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指2004年6月29日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会2004年6月8日颁布并于2004年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
元：	指人民币元；
基金份额分级：	自《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，两者的份额配比原则上不超过2:1；
双翼A：	诺德双翼分级债券型证券投资基金之双翼A份额，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；
双翼B：	诺德双翼分级债券型证券投资基金之双翼B份额。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；
双翼A开放日：	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基金份额折算：	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的基金份额净值调整为1.000元，其基金份额按折算比例相应增加或减少的行为；
双翼B的封闭期：	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；
《基金合同》生效后3年期届满日：	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；
《基金合同》生效后3年期届满时的基金转换：	《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）”。转换后的基金名称变更为“诺德双翼债券型证券投资基金（LOF）”；
上市交易公告书：	《诺德双翼分级债券型证券投资基金之双翼B份额上市交易公告书》；
上市交易所：	指深圳证券交易所；
基金管理人：	指诺德基金管理有限公司；
基金托管人：	指华夏银行股份有限公司；
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指诺德基金管理有限公司或接受诺德基金管理有限公司委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；
投资者：	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的总称；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续开依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人：	指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
基金份额持有人大会：	指按照《基金合同》第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
基金募集期：	指《基金合同》和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过3个月；
《基金合同》生效日：	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和《基金合同》规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指《基金合同》生效至终止之间的不定期期限；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
认购：	指在基金募集期内，投资者按照《基金合同》的规定申请购买本基金基金份额的行为；
发售：	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为；
申购：	指在《基金合同》生效后的存续期内，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
赎回：	指在《基金合同》生效后的存续期内，基金份额持有人按《基金合同》规定的条件要求基金管理人将其持有的基金份额兑换成现金的行为；
巨额赎回：	《基金合同》生效之日起3年内，在双翼A的单个开放日，经过申购与赎回申请的成交确认后，双翼A的净赎回金额（赎回确认金额扣除申购确认金额）超过本基金前一工作日基金资产净值的10%时的情形；《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，在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日本基金总份额的10%时的情形；
上市交易：	投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为；
基金转换：	指基金份额持有人按《基金合同》和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；
转托管：	指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；
指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
代销机构：	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及本基金代销机构的代销网点；
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体；
基金账户：	指注册登记机构为投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T日：	指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日；
T+n日：	指T日后（不包括T日）第n个工作日，n指自然数；
场外：	通过深圳证券交易所外的销售机构办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回；
场内：	通过深圳证券交易所所具有相应业务资格的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回；
注册登记系统：	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统；
证券登记结算系统：	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统；
系统内转托管：	基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为；
跨系统转托管：	基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为；
定期定额投资计划：	投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收益和因运用基金财产带来的成本或费用的节约；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金资产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的净资产值；
基金份额净值	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
虚拟清算：	“虚拟清算”原则指假设基金在净值公布日（非开放日）按照基金合同对双翼A和双翼B基金份额净值计算的规定对分级基金进行清算，该清算结果为双翼A和双翼B的基金份额参考净值，不能作为申购赎回的价格基础；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
货币市场工具	现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

三、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：杨亿凤

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：基金管理业务；募集、发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务。

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

联系人：张欣

联系电话：021-68879999

股权结构：

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%

（二）主要人员情况

1.基金管理人董事会成员：

杨亿凤先生，董事长。清华大学学士，美国University of Wisconsin-Madison电子材料与器件博士，金融学硕士。曾在美国多家金融机构任职，包括General Re Asset Management，J&W Seligman & Co.，Vantage Investment Advisors，Munder Capital Management，Lord，Abbett & Co. LLC；历任分析师、基金经理、投资基金经理、研究主管，资深投资顾问和董事经理；诺德基金管理有限公司成立后曾担任董事、总经理职务。

Zane E Brown先生，董事。国籍：美国，美国Clarion大学管理和市场营销学士，科罗拉多州立大学MBA，现任LORD ABBETT高级合伙人，历任Equitable资产管理公司执行副总裁、Brown Brothers Harriman公司的高级投资经理等职。

葛丽发先生，董事。中南财经政法大学硕士研究生毕业，现任长江证券股份有限公司副总裁、长江期货有限公司董事长。葛丽发先生之前曾先后担任长江证券股份有限公司经纪业务总部副总经理、营运管理总部主管等职务。

宋军先生，董事。清华大学工程力学学士、硕士、博士，现为清华大学教育基金会副理事长兼秘书长，历任清华大学副教授、清华大学科技开发部主任、清华控股有限公司董事长等职。

潘福祥先生，董事，总经理。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裁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。

张欣女士，董事。武汉大学金融学院硕士、EMBA，现任长江证券有限责任公司副总裁、研究所所长，历任长江证券债券事务部总经理、长江证券总裁助理等职。

张文娟女士，董事。管理学硕士、高级会计师。现任清华控股有限公司副总裁，兼任紫光股份有限公司监事、紫光集团有限公司董事、清华大学出版社有限公司监事会主席等职务，曾任清华大学财务处处长助理、副处长等职务。

史丹女士，独立董事。华中科技大学管理学院博士，现任中国社会科学院工经所研究员、曾任华北电力大学管理系讲师。

陈志武先生，独立董事。国籍：美国。国防科技大学硕士、美国耶鲁大学金融经济学博士，现任耶鲁大学金融教学与研究教授、Zebra Capital management基金合伙人，曾任Ohio State University金融教学与研究副教授。

郭峰先生，独立董事。中国人民大学法学院硕士、博士，中央财经大学法学院教授，曾任中国人民大学法学院讲师、副教授。

梁振雄先生，独立董事。清华大学工程物理系学士，曾任清华大学校副校长、国家会计学院院长等职。

2.基金管理人监事会成员：

李汉生先生，监事。国籍：中国澳门。香港大学计算机技术与应用数学专业学士，现任和鹏软件技术有限公司董事长兼CEO，曾任惠普中国区副总裁和万正数码公司总裁。

袁莲生先生，监事。中国人民大学MBA，现任清华控股有限公司资产管理中心主任，历任清华控股有限公司资产运营部高级经理、财务部副部长、财务部部长。

熊丽鸣先生，监事。中南财经大学会计系硕士，现任长江证券有限责任公司财务总部副总经理，历任财务总部副经理、经理。

崔晓妮女士，监事。华中理工大学学士，现任诺德基金管理有限公司运营总监，曾任职于华安基金管理有限公司。

陈国光先生，监事。清华大学工商管理硕士，现任诺德基金管理有限公司投资研究部基金经理助理，曾任清华兴业投资管理有限公司研究员。

3.公司高级管理人员：

杨亿凤先生，董事长。清华大学学士，美国University of Wisconsin-Madison电子材料与器件博士，金融学硕士。曾在美国多家金融机构任职，包括General Re Asset Management，J&W Seligman & Co.，Vantage Investment Advisors，Munder Capital Management，Lord，Abbett & Co. LLC；历任分析师、基金经理、资深基金经理、研究主管、资深投资顾问和董事经理；诺德基金管理有限公司成立后曾担任董事、总经理职务。

潘福祥先生，董事，总经理。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裁助理兼证券部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客座教授，诺德基金管理有限公司董事、副总经理职务。

张欣先生，董事。清华大学学士、美国Wayne State University经济学硕士，New York University工商管理硕士，曾任美国Alliance Bernstein L.P.固定收益研究部副总裁、MONY Capital Management，Inc.董事投资经理和Moody’s Investors Service分析师。

4.本基金基金经理

赵丽娟先生，上海财经大学金融学硕士。2006年10月至2008年10月，任职于平安资产管理有限责任公司（上海）。2008年10月加入诺德基金管理有限公司，主要负责解下基金的债券研究以及交易；2010年5月起担任诺德增强收益债券型基金基金经理，负责诺德增强收益债券型基金的债券研究投资。

5.投资决策委员会成员

公司总经理潘福祥先生、投资总监向明勇先生、投研部经理胡志伟先生。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1.依法申请并募集基金、办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2.办理基金备案手续；

3.自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和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.按《基金合同》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；

7.除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

8.进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

9.依法编送基金投资人的监督；

10.编制季度、半年度和年度基金报告；

11.采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

12.计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

13.严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露义务；

14.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；

15.按照规定要求召开基金份额持有人大会或者通讯开会方式召开基金份额持有人大会或者通讯表决，对大会所议事项的决定做成会议纪要，保证会议的召集、召开、议事及决议的内容均符合法律、法规、规章的有关规定；

16.为基金份额持有人的利益行使因基金财产被侵占而产生的权利；

17.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；

18.提议更换基金托管人；

19.提议调低基金管理费、基金托管费；

20.提议变更《基金合同》的投资范围、投资目标、投资策略、基金份额持有人的权利和义务、基金份额的分类、费率结构、基金份额持有人大会召开的条件、基金份额持有人大会的议事内容、基金份额持有人大会的议事程序、基金份额持有人大会表决的方式、基金份额持有人大会决议的生效条件、基金份额持有人大会决议的表决权、基金份额持有人大会决议的公布、基金份额持有人大会决议的实施、基金份额持有人大会的其他有关事项；

21.决定基金份额持有人大会的权益登记日；

22.决定基金份额持有人大会的议题；

23.决定基金份额持有人大会的召集人；

24.决定基金份额持有人大会的表决方式；

25.决定基金份额持有人大会的计票方式；

26.决定基金份额持有人大会的生效条件；

27.决定基金份额持有人大会的公布方式；

28.决定基金份额持有人大会决议的实施；

29.决定基金份额持有人大会的其他有关事项；

30.提议、决定更换基金管理人；

31.提议、决定基金合并、基金财产转入其他基金管理人管理的事项；

32.提议、决定基金终止；

33.决定基金份额持有人大会的其他有关事项；

34.法律法规、《基金合同》赋予基金份额持有人大会的其他权利；

35.法律法规、《基金合同》规定的基金份额持有人大会的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1.本基金管理人将根据《基金合同》的规定，根据招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2.基金管理人承诺不从事违反《基金法》及其他法律法规规定或监管部门批准的其他业务；

3.基金管理人不从事违反《基金法》及其他法律法规的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

①将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

②不公平地对待管理的不同基金财产；

③利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

④损害基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

⑤利用基金财产承销证券；

⑥利用基金财产向他人贷款或提供担保；

⑦利用基金财产从事无限责任的投资；

⑧利用基金财产买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；

⑨以基金财产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

⑩以基金财产买卖与基金管理人、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；

⑪利用基金财产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

⑫违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；

⑬法律、法规、中国证监会及《基金合同》禁止的其他行为。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，倡促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范、诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

①越权或违规经营；

②违反《基金合同》或托管协议又有关法律法规；

③故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

④在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；

⑤拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

⑥玩忽职守、滥用职权；

⑦泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容，基金投资计划等信息；

⑧除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

⑨违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

⑩欺骗同行，以提高自己；

⑪在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

⑫以不正当手段谋求业务发展；

⑬贬损社会公德、损害正券投资基金人员形象；

⑭参与洗钱或为洗钱活动提供协助；

⑮法律法规禁止的其他行为。

5、基金经理承诺

①依照有关法律、法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

②不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受贿人或任何其他第三人谋取利益。

③不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

④不得从事损害基金资产的行为。

⑤不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

⑥账相同行，以提高自己；

①在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

②以不正当手段谋求业务发展；

③贬损社会公德、损害正券投资基金人员形象；

④参与洗钱或为洗钱活动提供协助；

⑤法律法规禁止的其他行为。

5、基金经理承诺

①依照有关法律、法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

②不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受贿人或任何其他第三人谋取利益。

③不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

④不得从事损害基金资产的行为。

⑤不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

1.内部控制的目标

①保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

②防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

③确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

2.内部控制的原则

①健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

②有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

③独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

④相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明，相互制衡。

⑤成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制制度

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

公司制定内部控制制度遵循了以下原则：

①合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章的有关规定。

②全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

③审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

④适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

4、内部控制系统

公司的内部控制系统是一个分工明确、相互牵制、完备严密的系统。公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，各个业务部门负责本部门的内部控制，督察长和监察稽核部负责检查公司的内部控制措施的执行情况。具体而言，包括如下组成部分：

①董事会

负责制定公司的内部控制大纲，对公司内部控制负完全的和最终的责任。

②督察长

负责公司及其业务运作的监察稽核工作，对公司内部控制的执行情况进行监督检查。督察长对董事会负责，将定期和不定期向董事会报告公司内部控制的执行情况，并定期向中国证监会呈送督察长评估报告。

③监察稽核部

监察稽核部负责对公司各部门内部控制的执行情况进行监督。监察稽核部对经理负责，将定期和不定期对各业务部门内部控制制度的执行情况和遵守国家法律法规及其他规定的执行情况进行检查，适时提出修改建议，并定期向中国证监会呈送监察稽核报告。

④业务部门

内部控制是每一个业务部门的责任。各部门总监对本部门的内部控制负直接责任，负责履行公司的内部控制制度，并负责建立、执行和维护本部门的内部控制措施。

5、基金管理人关于内部控制的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）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：42亿元人民币

联系电话：010-85238667

联系人：郑鹏

（二）托管人组织情况

华夏银行基金托管部成立于2004年7月，2009年8月更名为资产托管部，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，并在上海、深圳分行设立2个托管分部。资产托管部共有员工31人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

1.董事长

吴建，董事长，男，1954年3月出生，大学本科，高级经济师。曾任中国工商银行北京分行设备信贷处副处长、中国工商银行北京分行朝阳区分办事处副主任、主任；交通银行北京分行副总经理、党组成员，交通银行北京分行总经理、党委书记，交通银行党组成员、纪检组长、副行长、党委委员；华夏银行董事、行长、党委副书记。现任华夏银行董事长、党委书记。

2.行长

樊大志，董事，行长，男，1964年9月出生，硕士研究生，高级会计师。曾任北京国际信托投资公司投资银行总部总经理；北京市境外融投资管理中心党组成员、副主任；北京市国有资产经营有限责任公司党组成员、董事、副总经理；北京证券有限责任公司党委副书记、董事、总经理；瑞银证券有限责任公司监事长；华夏银行董事、党委副书记。现任华夏银行董事、党委书记。

3、资产托管部总经理

许明，资产托管部总经理，男，1966年10月出生，研究生学历，博士学位。曾任海南省证券公司武汉营业部副总经理；亚洲证券有限责任公司总裁办公室主任、研究所所长、北京营业部总经理；巨田证券有限公司研究所所长、投资部总经理、资产管理总部总经理、公司总经理助理、副总经理；摩根士丹利华鑫基金管理有限公司《职员日基金管理有限公司》董事、总经理；华夏银行资产托管部总经理。现任华夏银行资产托管部总经理。

（三）基金管理业务经营情况

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》规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，为广大基金投资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2011年3月末，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及其它受托资产产品。

（四）基金托管人的内部风险控制制度说明

1.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。

2.内部控制组织结构

内部监督委员会直接负责华夏银行股份有限公司的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管部专门设置了风险管理处，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职权和能力。

3.内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，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，剩空机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施容像监控；业务信息由专职信息披露人负责，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。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他规定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五、相关服务机构

（一）基金销售机构：

1、以双A的方投机构

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：杨亿凤

客户服务电话：400-888-0009 021-68604888

传真：021-68882526

联系人：孟晓君

网址：www.lordabbettchina.com

②代销机构

①华夏银行

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

客户服务统一咨询电话：95577

网址：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：肖钢

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：张建国（代行）

客户服务统一咨询电话：95533

网址：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：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

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：丰萌

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

（下转A30版）

诺德双翼分级债券型证券投资基金基金份额发售公告

公告日期：2012年1月5日

重要提示

1、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证监基字【2011】1691号文批准。

2、本基金的管理人为诺德基金管理有限公司（以下简称“本公司”），托管人为华夏银行股份有限公司（以下简称“华夏银行”），注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

3、本基金为债券型基金，基金运