诺德双翼分级债券型证券投资基金招募说明书（摘要）

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

二〇一二年九月

【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，为风险较低、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2012年8月15日，财务数据和净值表现截止至2012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：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：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：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%

管理基金：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、诺德中小盘票息型证券投资基金、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。

（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，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。

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。

董腊发先生，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。董腊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。

马莉女士，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。

梁献能先生，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：

姜谨先生，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。

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，现任和勤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。

熊雷鸣先生，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旗下诺德周期策略股票型基金金经理、诺德主题灵活配置混合型基金基金经理，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。

张欣先生，督察长，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AllianceBernstein 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。

5.投资决策委员会成员

公司总经理潘福祥先生、投资总监胡志伟先生、研究副总监周勇先生。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（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：6,849,725,776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：刘鹏

电话：010-85238667

传真：010-85238680

（二）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32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2012年6月末，已托管长城货币市场基金、国联安德融精选股票基金、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及其它受托资产产品，托管各类资产规模3951.68亿元。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构：

1、双翼A的发售机构

（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：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

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：王洪章

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：上海市浦东新区商城路618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168 号

法定代表人：万建华

客户服务电话：400-888-8666

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（仅国内）.021-95553

公司网址：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）齐鲁证券有限公司

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

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（仅国内）

业务联系电话：021-53519888

公司网址：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

天相投顾网：www.txsec.com

天相基金网：https://jijin.txsec.com

14）财富证券有限公司

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（仅国内）

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）信诺证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

业务联系电话：010-88085201

传真：010-88085344

客户服务热线：400-800-0562

宏源证券网站：www.hysec.com

18）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

19）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

20）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

21）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘昌、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

22）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.cindase.com

23）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

24）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

25）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：4008888123

联系人：谢尚荷

业务联系电话：021-38565785

兴业证券公司网站：www.xyzq.com.cn；

26）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

27）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：020-87324668

传真：020-87325036

联系人：林洁茹

客户服务电话：020-961303

网址： www.gzs.com.cn

28）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：4008888508 或0571-96523

网址：www.hzbank.com.cn

29）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

30）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.mszq.com

31）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

32）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：北京市朝阳门内大街188 号

法定代表人：王常青

联系电话：4008888108

联系人：权益

中信建投证券客户咨询电话：4008888108

公司网址：www.csc108.com

33）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：牟坤

联系电话：010-58328112

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

34）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

35）东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 号中国风凰大厦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

36）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

37）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

38）深圳众禄基金销售有限公司

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047 号发展银行大厦25 楼I、J 单元

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：0755-82080798

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

39）第一创业证券有限责任公司

办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12 号中民时代广场B 座25、26 层

法定代表人：刘学民

电话：0755-25832583

网址：www.firstcapital.com.cn

40）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：周嫣旻

电话：0571-28829790、021-60897869

传真：0571-26698533

41）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

42）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588 号恒鑫大厦主楼19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588 号恒鑫大厦主楼19、20 层

法定代表人：沈强

客服电话：0571-96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

双翼A的其他代销机构情况详见本基金《发售公告》。

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.双翼B的发售机构

（1）场外发售机构

1）直销机构：诺德基金管理有限公司，销售机构信息同上。

2）代销机构：

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 号华夏银行大厦

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

3）双翼B的其他代销机构情况详见本基金《发售公告》。

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新增为双翼B的场外发售机构，并及时公告。

（2）场内发售机构

双翼B的场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，具体发售机构见《发售公告》。

双翼B募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可新增为双翼B的场内发售机构。

（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：梁丽金、刘佳

（四）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：邹豪伟

经办会计师：汪棣 薛竞

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一个工作日，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

双翼A、双翼B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》生效后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。

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：

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年期间，基金管理人在计算基金资产净值的基础上，采用“整权清算”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

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。

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年期间，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分级债券型证券投资基金

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一个工作日，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、基金份额折算方案最迟于实施日前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，基金份额仍将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》生效之日起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