（上接B54版）

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：

[illegible]

（2）双翼B的基金份额净值计算

设 NAV_B^T 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：

[illegible]

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：

[illegible]

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

[illegible]

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：

[illegible]

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：

[illegible]

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、基金份额折算方案须最迟于实施日前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，确定信用债品种的投资比例。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。本基金将通过对可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（2017第2季度）》，报告截至日期为2017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	基金投资	–	–
3	固定收益投资	2,424,567.00	71.59
	其中：债券	2,424,567.00	71.59
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	600,000.00	17.72
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	300,128.76	8.86
8	其他资产	62,002.50	1.83
9	合计	3,386,698.26	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	2,424,567.00	85.89
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	2,424,567.00	85.89

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	019546	16国债18	19,700	1,967,833.00	69.71
2	020171	17贴债15	4,600	456,734.00	16.18

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国债期货交易情况说明

9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

9.2 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。

9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

10投资组合报告附注

10.1本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不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。

10.2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。

10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,382.34
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	41,620.16
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	62,002.50

10.4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。

10.5报告期末前十名股票中在在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

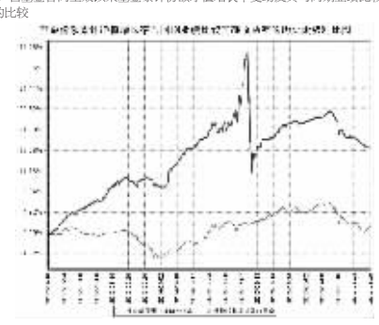
十五、基金的业绩

基金管理人依照格尽职守、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12月31日	−0.60%	0.10%	−1.80%	0.13%	1.20%	−0.03%
2017年1月1日至2017年6月30日	−3.34%	0.10%	−2.48%	0.11%	−0.86%	−0.01%

（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



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2017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×0.70%÷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×0.20%÷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×0.40%÷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，更新了基金托管人的相关信息；

3、 在“四、基金托管人”中，更新了基金托管人的相关信息；

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

二〇一七年九月二十八日

证券代码：600759　证券简称：洲际油气　公告编号：2017-087

洲际油气股份有限公司 2017年第六次临时股东大会决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

重要内容提示：

●本次会议是否有否决议案：无

一、会议召开和出席情况

(一)股东大会召开的时间：2017年9月27日

(二)股东大会召开的地点：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦A座三层公司会议室

(三)出席会议的普通股股东和恢复表决权的优先股股东及其持有股份情况：

1、出席会议的股东和代理人人数	13
2、出席会议的股东所持有表决权的股份总数（股）	326,383,902
3、出席会议的股东所持有表决权股份数占公司有表决权股份总数的比例（%）	14.4193

(四)表决方式是否符合《公司法》及《公司章程》的规定，大会主持情况等。

会议由公司董事会召集，董事长姜亮先生主持。本次会议采取现场投票及网络投票的方式召开并表决，会议的召集和召开符合《公司法》、《上市公司股东大会议事规则》等有关法律法规和《公司章程》的规定。

(五)公司董事、监事和董事会秘书的出席情况

1、公司在任董事7人，出席6人，独立董事江榕因工作原因未能出席本次会议；

2、公司在任监事3人，出席3人；

3、董事会秘书樊辉先生出席了本次会议；部分高管人员列席了本次会议。

二、议案审议情况

(一)非累积投票议案

1、议案名称：关于修改上海泷洲鑫科能源投资有限公司章程的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	326,307,812	99.9766	51,090	0.0156	25,000	0.0078

(二)涉及重大事项，5%以下股东的表决情况

议案序号	议案名称	同意		反对		弃权	
		票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
1	关于修改上海泷洲鑫科能源投资有限公司章程的议案	26,708,614	99.7159	51,090	0.1907	25,000	0.0934

(三)关于议案表决的有关情况说明

1、议案1为普通决议事项，经出席会议股东或股东代表所持有效表决权股份总数的1/2通过；

2、议案1涉及关联交易，公司控股股东广西正和实业集团有限公司与上海泷洲鑫科能源投资有限公司股东之一常德久富贸易有限公司为一致行动人。广西正和实业集团有限公司持有公司的股份数量为665,081,232股，对于议案1回避表决。

三、律师见证情况

1、本次股东大会鉴证的律师事务所：湖南启元律师事务所

律师：徐樱、达代炎

2、律师鉴证结论意见：

湖南启元律师事务所徐樱律师和达代炎律师见证了本次股东大会，并发表了法律意见。其意见为：本次股东大会的召集和召开程序、召集人和出席人员的资格、表决程序和表决结果符合《公司法》、《股东大会规则》及《公司章程》的相关规定，合法、有效。

四、备查文件目录

1、经与会董事和记录人签字确认并加盖董事会印章的股东大会决议；

2、经鉴证的律师事务所主任签字并加盖公章的法律意见书。

洲际油气股份有限公司

2017年9月27日

证券代码：600759　证券简称：洲际油气　公告编号：2017-089

洲际油气股份有限公司 关于董监高延期增持公司股份的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

2017年4月27日，洲际油气股份有限公司（以下简称“公司”）对外披露《关于控股股东及董监高增持股份的公告》（以下简称“原增持计划”），公司全部或部分董事、监事、高级管理人员（以下简称“公司董监高”）及公司主要骨干人员将在增持公告披露后的6个月内（截止日期为2017年10月26日）通过上海证券交易所的交易系统增持公司股票金额5000—10000万元。原增持计划披露后，公司部分董监高积极努力筹措资金，以备实施上述增持计划。但由于近期公司股价下跌幅度较大，控股股东广西正和实业集团有限公司（以下简称“广西正和 ”）持有的公司股份又面临补仓和被强制平仓的风险，同时在增持期间内，公司发生了较多重大事项，导致信息敏感期较长，目前公司董监高又面临2017年第三季度报告披露前的窗口期，一定程度上影响了公司董监高的融资环境和增持时点的把握。

鉴于上述多方面因素的影响，且目前已临近三季报的窗口期，公司董监高近期内难以完成原定增持计划。基于对于公司未来前景的信心，经全体董监高慎重考虑，拟将公司全部或部分董监高及公司主要骨干人员增持公司股份的计划期限延长，自2017年10月26日起6个月内完成，上市公司股票因筹划重大事项连续停牌10个交易日以上的，增持计划将在股票复牌后顺延实施并及时披露。

2017年9月27日，公司以现场结合通讯表决的方式召开第十一届董事会第二十五次会议，以7票同意，0票反对，0票弃权的表决结果，审议通过了《关于董监高延期增持公司股份的议案》。

本次延期后，公司全部或部分董监高及公司主要骨干人员增持公司股份的计划如下：

一、增持主体基本情况

（一）增持主体为：公司全部或部分董监高及公司主要骨干。

（二）截至目前，公司董事长姜亮先生持有公司股份40,000股，公司董事会秘书樊辉先生持有公司股份10,000股。

（三）增持主体在本议案之前十二个月内曾披露增持计划，详情请见2017年4月27日对外披露的《关于控股股东及董监高增持股份的公告》。

二、增持计划的主要内容

（一）拟增持股份的目的：基于目前股价的异常波动，为稳定投资者信心，以及对公司未来持续发展的信心和对公司价值的认可。

（二） 拟增持股份的种类：A股。

（三） 拟增持股份的金额：公司全部或部分董监高及公司主要骨干人员将增持公司股票金额5000—10000万元。

（四）拟增持股份的价格：本次增持不设价格区间，将根据公司股票价格波动情况及资本市场整体趋势，逐步实施增持计划。

（五）拟增持股份的资金安排：自有资金或自筹资金。

（六）增持股份计划的实施期限：自2017年10月26日起6个月内。增持计划实施期间，上市公司股票因筹划重大事项连续停牌10个交易日以上的，增持计划将在股票复牌后顺延实施并及时披露。

三、其他说明

（一）参与本次增持计划的公司董监高及主要骨干人员承诺：本次增持行为发生之日起6个月内不减持其所持有的公司股份。

（二）增持主体在实施增持计划过程中，将遵守证监会、上海证券交易所关于上市公司权益变动及股票买卖敏感期的相关规定。

（三）增持计划实施期间，公司发生派发红利、送红股、转增股本、增发新股或配股等股本除权、除息事项的，增持主体将当根据股本变动，对增持计划进行相应调整并及时披露。

（四）增持计划实施完毕或增持期限届满后的两个交易日内，增持主体将发布增持计划实施结果公告，披露增持数量、金额、比例及本次增持后的实际持股比例。

（五）增持期限届满仍未达到计划最低增持额的，增持主体将公告说明原因。

（六）公司将根据《上海证券交易所股票上市规则》、《上市公司收购管理办法》和《上海证券交易所上市公司股东及其一致行动人增持股份行为指引》的相关规定，持续关注增持主体增持公司股份的有关情况，及时履行信息披露义务。

因本次增持计划未能在原定期限内完成，公司董事会深表遗憾，将督促公司增持主体充分考虑资金安排、时间窗口等影响增持的因素，合法合规地完成增持计划。

四、风险提示

本次增持计划延期可能会出现增持股份所需资金未能到位，导致增持计划无法实施的风险。

公司有关信息请以指定披露媒体《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》以及上海证券交易所网上发布的信息为准。

特此公告。

洲际油气股份有限公司

董 事 会

2017年9月27日

证券代码：600759　证券简称：洲际油气　公告编号：2017-088

洲际油气股份有限公司 关于控股股东广西正和持有公司股份已全部解除司法冻结的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

2017年7月27日，洲际油气股份有限公司（一下简称“公司”）对外披露了《关于平安银行向法院申请冻结广西正和股份的提示性公告》，因平安银行诉广西正和一案，公司控股股东广西正和实业集团有限公司所持有的公司665,081,232股被司法冻结。

2017年9月2日，公司对外披露了《关于控股股东所持股份被司法冻结及达成和解的提示性公告》，因邵天裔诉广西正和