

东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF） 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十五日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 43 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 43 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 43 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 44 |
| 7.6 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..... | 44 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 45 |
| 7.8 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贵金属投资明细..... | 45 |
| 7.9 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..... | 45 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 45 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 47 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 47 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 47 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 48 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 48 |
| §10 重大事件揭示..... | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 48 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 49 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 49 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 49 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 49 |
| 10.8 其他重大事件..... | 50 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 52 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况..... | 52 |

| | |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 52 |
| §12 备查文件目录..... | 53 |
| 12.1 备查文件目录..... | 53 |
| 12.2 存放地点..... | 53 |
| 12.3 查阅方式..... | 53 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|--------------------|
| 基金名称 | 东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF） |
| 基金简称 | 东吴鼎利（LOF） |
| 场内简称 | 东吴鼎利 |
| 基金主代码 | 165807 |
| 交易代码 | 165807 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |
| 基金转型生效日 | 2016 年 4 月 26 日 |
| 基金管理人 | 东吴基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 173,260,371.48 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2016 年 5 月 20 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过对债券组合久期、期限结构、债券品种的主动式管理，力争提供稳健的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金为纯债基金，在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过对债券组合久期、期限结构、债券品种的主动式管理，力争提供稳健的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中国债券综合全价指数。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|---------------------------|-------------------|
| 名称 | | 东吴基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 徐军 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 021-50509888-8308 | 95559 |
| | 电子邮箱 | xuj@scfund.com.cn | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 021-50509666/400-821-0588 | 95559 |
| 传真 | | 021-50509888-8211 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 上海浦东源深路 279 号 | 上海市浦东新区银城中路 188 |

| | | |
|-------|---------------|-------------------|
| | | 号 |
| 办公地址 | 上海浦东源深路 279 号 | 上海市浦东新区银城中路 188 号 |
| 邮政编码 | 200135 | 200120 |
| 法定代表人 | 王炯 | 牛锡明 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报、中国证券报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.scfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及托管人办公处 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | -1,345,851.01 |
| 本期利润 | 5,622,387.46 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0148 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.44% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.96% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 49,547,059.86 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2860 |
| 期末基金资产净值 | 180,702,634.07 |
| 期末基金份额净值 | 1.043 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 4.30% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

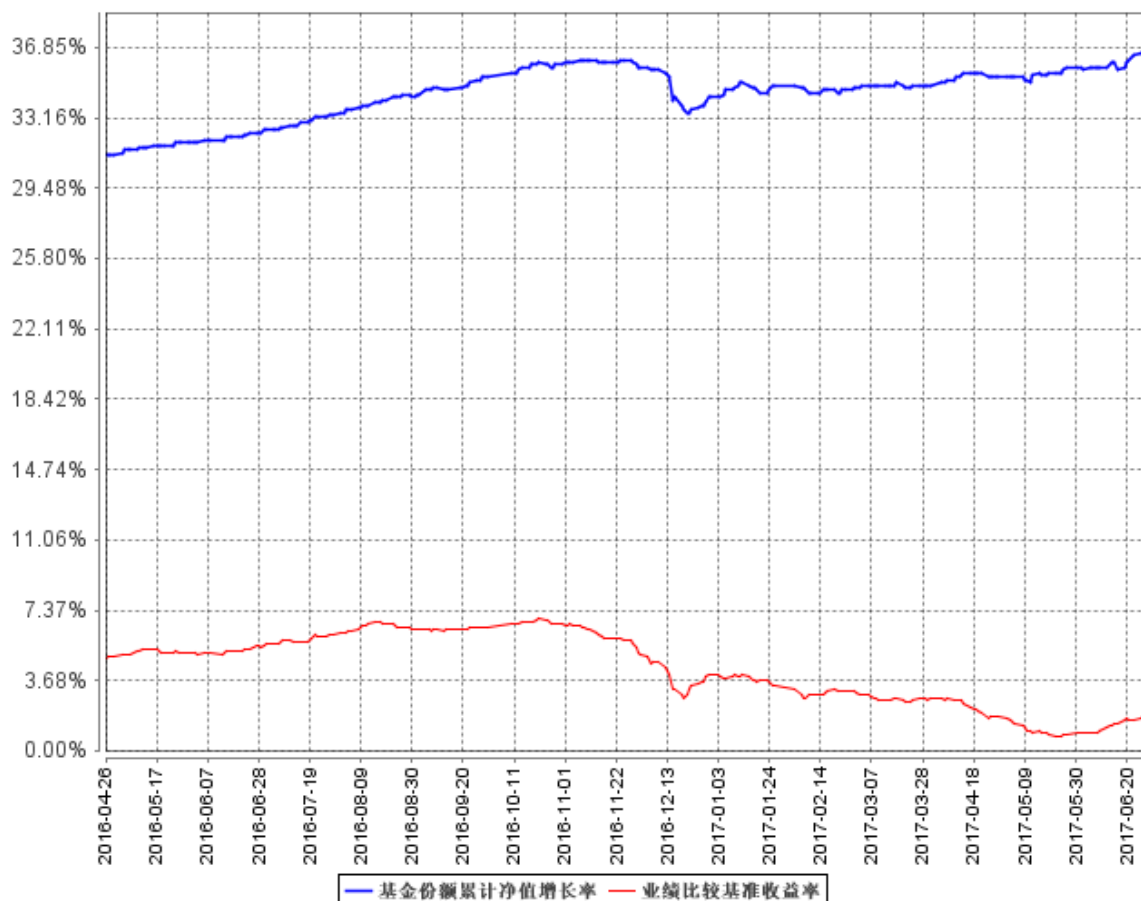
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率 | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | - | - |
|------------|---------|------------|-----------|--------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.77% | 0.10% | 0.90% | 0.06% | -0.13% | 0.04% |
| 过去三个月 | 1.46% | 0.08% | -0.88% | 0.08% | 2.34% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.96% | 0.08% | -2.11% | 0.08% | 4.07% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.27% | 0.09% | -3.50% | 0.10% | 6.77% | -0.01% |
| 自基金转型生效起至今 | 4.30% | 0.09% | -2.83% | 0.09% | 7.13% | 0.00% |

注：比较基准=中国债券综合全价指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、比较基准=中国债券综合全价指数。

2、本基金转型日为 2016 年 4 月 26 日，图示日期为 2016 年 4 月 26 日至 2017 年 6 月 30 日。

3、转型后的投资范围及投资比例与转型前一致；本报告期内，转型后本基金的各项投资比例符合基金合同约定的各项投资范围及比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司于 2004 年 8 月 27 日获证监基金字[2004]32 号开业批文,并于 2004 年 9 月 2 日正式成立。注册资本 1 亿元人民币,公司所在地为上海市浦东新区源深路 279 号,统一社会信用代码 913100007664967591。目前由东吴证券股份有限公司和上海兰生(集团)有限公司分别控股 70%和 30%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。

在泛资管大背景下,公司近年来推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展,加快向具有核心竞争力的综合性现代财富管理机构转型。

截至 2017 年二季度末,公司整体资产管理规模为 734.06 亿元,其中公募基金 247.63 亿元,专户业务 180.62 亿元,子公司 305.81 亿元;旗下管理着 25 只公募基金,42 只存续专户资产管理计划,88 项存续专项资产管理计划,形成了高中低不同风险层次的多元化产品线。

经过多年积累和布局,公司的公募业务已形成三大投研特色:1.权益投资坚持自下而上精选优质成长股的投资风格,把握中国经济转型升级机遇;2.绝对收益提倡“用权益投资做绝对收益”的理念,借助量化模型进行择时和选股;3.固定收益以稳健为本,兼顾收益率和流动性,为大类资产配置提供基础性工具。

尤其是 2015 年以来,公司在成长股投资的传统优势基础上,引入了量化投资策略,发行了多只量化公募产品,并在业内率先成立了绝对收益部。

2017 年,公司对投研模块进行了变革,引进了彭敢等公募行业领军人物,投研磨合红利已开始显现,尤其是固定收益投资崭露头角。据海通证券固定收益类资产业绩排行榜显示,截至 2017 年二季度末,东吴基金旗下的固定收益类基金以 2.44%的规模加权平均收益,位列 98 家入选基金公司的第六位。

今年以来,公司在固定收益领域获得了多个奖项,比如 2016 年度积极债券型明星基金*东吴增利债券基金(《证券时报》)、2016 年度最受欢迎债券类基金*东吴鼎利债券基金 LOF(东方财富风云榜)等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杨庆定 | 固定收益部总经理、本基金基金经理 | 2013年6月25日 | - | 11年 | 博士，上海交通大学管理学专业毕业。历任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理、上海证券有限公司高级经理、太平资产管理有限公司高级投资经理；2007年7月至2010年6月期间任东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理；2013年4月再次加入东吴基金管理有限公司，现担任公司固定收益部总经理，其中自2013年6月25日起担任东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）（原东吴鼎利分级债券型证券投资基金）基金经理、自2014年5月9日起担任东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金经理、自2014年6月28日起担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理、自2015年8月19日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理，自2016年5月19日起担任东吴鼎元双债债券型证券投资基金基金经理。 |
| 陈晨 | 本基金基金经理 | 2015年6月8日 | - | 5.5年 | 硕士，2011年6月获厦门大学硕士学位。2011年6月至2013年2月就职于华泰（联合）证券研究所任固定收益研究员，自2013年3月起加入东吴基金管理有限公司，一直从事债券投资研究工作，曾任固定收益部研究员、基金经 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 理助理，自 2015 年 6 月 8 日起担任东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）（原东吴鼎利分级债券型证券投资基金）基金经理，自 2016 年 11 月 7 日担任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，因本基金持有的个别债券连续停牌，本基金出现连续十个交易日以上持有一家发行的证券市值超过基金资产净值 10%的情形。除此之外，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律、法规规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司研究策划部的研究工作实行信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合组合互相之间的输送金额总额、贡献度等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济基本面较好，GDP 同比增速 6.9%。固定资产投资增速始终高于 8.5%，基建持续发力，三四线城市棚改支撑地产销售，地产投资增速维持相对高位，制造业投资增速低位企稳。海外经济复苏环境下出口明显改善。通胀方面，PPI 同比增速自今年 2 月触顶后有所回落，CPI 同比增速仍保持在 1.5% 以下较低水平。

1 季度央行货币政策保持偏紧基调，春节前后数次上调各项流动性投放工具操作利率，有关表外理财、同业存单等方面的监管措施对市场情绪影响负面，3 月末 MPA 考核对银行体系流动性构成较大压力并传导至非银机构。2 季度以来金融系统相关监管与服务机构均出台相关政策措施，金融监管思路也逐渐清晰：一方面是“去杠杆”的大方向不会变化，另一方面是在“去杠杆”的过程中会注意节奏，避免制造新的风险，以时间换空间。

债券市场表现来看，在经济平稳及监管加码的环境下，上半年债市收益率整体上行，10 年期国债收益率由去年底 3.0% 上行至 3.6%-3.7% 区间，6 月随着市场对监管预期的改善以及资金面的好转，收益率有所下行，存单与信用债收益率也有明显回落。

本基金在报告期内保持低久期及低杠杆水平，较好应对了流动性需求，并取得较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日本基金份额净值为 1.043 元，累计净值 1.339 元；本报告期份额净值增长率 1.96%，同期业绩比较基准收益率为 -2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济保持平稳，主导市场的主要因素在于金融监管的力度、方式以及市场对监管政策的预期。在“去杠杆”措施的推行过程中，资金价格的绝对水平与波动性都明显抬高，现金类资产收益优于债券类资产。进入下半年，央行货币政策将保持稳健中性，市场对央行的流动性调节方式已有较为明确的认知，金融监管思路也较为明晰，因此下半年国内货币与监管政策对市场的边际影响因素将有所淡化，而国内与海外经济基本面，以及海外政策环境的不确定性可能加大，其对债券市场的影响力度将会加大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司副总经理、基金会计、固定收益部总经理、绝对收益部总经理、权益投资部副总经理、金融工程相关业务人员、合规风控人员等组成，同时，督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；公司副总经理、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、合规风控人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 年上半年度，基金托管人在东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2017 年上半年度，东吴基金管理有限公司在东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017 年上半年度，由东吴基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：东吴鼎利债券型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,426,310.53 | 3,636,962.96 |
| 结算备付金 | | 2,262,688.28 | 17,662,172.48 |
| 存出保证金 | | 63,663.16 | 60,608.36 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 155,510,973.48 | 702,302,149.55 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 155,510,973.48 | 702,302,149.55 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 19,400,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | 1,418,362.48 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 3,464,407.09 | 16,815,665.75 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 129,109.25 | 563,148.76 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 183,675,514.27 | 741,040,707.86 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 180,830,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 1,736,874.25 | 2,625,605.11 |
| 应付赎回款 | | 868,069.22 | 3,177,034.03 |
| 应付管理人报酬 | | 116,374.76 | 482,179.36 |
| 应付托管费 | | 33,249.93 | 137,765.53 |
| 应付销售服务费 | | 58,187.38 | 241,089.68 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 693.93 | 2,825.00 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应交税费 | | 724.06 | 724.06 |
| 应付利息 | | - | 10,985.75 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 158,706.67 | 260,652.24 |
| 负债合计 | | 2,972,880.20 | 187,768,860.76 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 125,858,518.84 | 392,892,807.32 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 54,844,115.23 | 160,379,039.78 |
| 所有者权益合计 | | 180,702,634.07 | 553,271,847.10 |
| 负债和所有者权益总计 | | 183,675,514.27 | 741,040,707.86 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.043 元，基金份额总额 173,260,371.48 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴鼎利债券型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日(基 金转型生效日)至 2016 年 6 月 30 日 |
|--------------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 9,330,089.97 | 5,769,361.70 |
| 1.利息收入 | | 13,284,229.26 | 4,670,317.57 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 75,773.35 | 54,596.23 |
| 债券利息收入 | | 13,162,834.63 | 4,583,233.53 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 45,621.28 | 32,487.81 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -10,947,002.10 | 2,113,627.94 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -10,947,002.10 | 2,113,627.94 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.2 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 1) 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 6,968,238.47 | -1,022,970.58 |
| 2) 4.汇兑收益（损失以“-” | | - | - |

| | | | |
|-----------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| 号填列) | | | |
| 3) 5.其他收入 (损失以“-”号填列) | 6.4.7.17 | 24,624.34 | 8,386.77 |
| 减:二、费用 | | 3,707,702.51 | 1,272,652.64 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,370,589.65 | 590,486.15 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 391,597.03 | 168,710.31 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 685,294.85 | 295,243.07 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 7,943.10 | 7,696.13 |
| 5. 利息支出 | | 1,073,682.88 | 154,809.69 |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | 1,073,682.88 | 154,809.69 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 178,595.00 | 55,707.29 |
| 三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列) | | 5,622,387.46 | 4,496,709.06 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润 (净亏损以“-”号填列) | | 5,622,387.46 | 4,496,709.06 |

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 东吴鼎利债券型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 392,892,807.32 | 160,379,039.78 | 553,271,847.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | - | 5,622,387.46 | 5,622,387.46 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | -267,034,288.48 | -111,157,312.01 | -378,191,600.49 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 133,541,063.03 | 55,511,286.39 | 189,052,349.42 |
| 2. 基金赎回款 | -400,575,351.51 | -166,668,598.40 | -567,243,949.91 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基 | - | - | - |

| | | | |
|--|---|----------------|-----------------|
| 金净值变动 (净值减少以“-”号填列) | | | |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 125,858,518.84 | 54,844,115.23 | 180,702,634.07 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016年4月26日(基金转型生效日)至2016年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 390,228,113.32 | 147,058,095.22 | 537,286,208.54 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | 0.00 | 4,496,709.06 | 4,496,709.06 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -55,779,184.95 | -21,084,722.19 | -76,863,907.14 |
| 其中：1.基金申购款 | 133,795,470.95 | 51,404,722.22 | 185,200,193.17 |
| 2.基金赎回款 | -189,574,655.90 | -72,489,444.41 | -262,064,100.31 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 334,448,928.37 | 130,470,082.09 | 464,919,010.46 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王炯

基金管理人负责人

_____ 吕晖

主管会计工作负责人

_____ 沈静

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

本基金根据【2012】年【11】月【29】日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴鼎利分级债券型证券投资基金募集的批复》(证监基金字【2012】【1609】号)的核准,进行募集。由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集,基金合同于2013年4月25日正式生

效，首次设立募集规模为 1,120,666,599.93 份基金份额。本基金为上市契约型开放式（LOF），存续期限不定。本基金的基金管理人为东吴基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据基金合同的相关规定，基金合同生效后 3 年期届满，自动转换为上市开放式，鼎利 A、鼎利 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。

根据基金合同的相关规定，本基金的分级运作期于 2016 年 4 月 25 日届满，经深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上【2016】207 号）同意，本基金鼎利 B 份额于 2016 年 4 月 25 日终止上市。

本基金转换基准日为 2016 年 4 月 25 日，该日日终，东吴鼎利优先、东吴鼎利进取按照各自基金份额净值转换成东吴鼎利（LOF）份额分别为 6,841,900.95 份、530,444,305.38 份。自 2016 年 4 月 26 日起，基金名称变更为“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）”。

转型后东吴鼎利（LOF）于 2016 年 5 月 20 日在深圳证券交易所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

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债券、货币市场工具、银行存款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相关规定）。

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则 - 基本准则》、具体会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会基金部发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金声明：本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况，经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

1、营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服

务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 1,426,310.53 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |

| | |
|-----|--------------|
| 合计： | 1,426,310.53 |
|-----|--------------|

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | | |
|---------------|-------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 145,927,465.62 | 143,396,473.48 |
| | 银行间市场 | 12,844,750.88 | 12,114,500.00 |
| | 合计 | 158,772,216.50 | 155,510,973.48 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 158,772,216.50 | 155,510,973.48 | -3,261,243.02 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | |
|-----------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中；买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 15,500,000.00 | - |
| 买入返售证券_深圳 | 3,900,000.00 | - |
| 合计 | 19,400,000.00 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 253.93 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 916.38 |
| 应收债券利息 | 3,462,382.93 |
| 应收买入返售证券利息 | 828.02 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 25.83 |
| 合计 | 3,464,407.09 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 693.93 |
| 合计 | 693.93 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 22.16 |
| 预提审计费 | 34,712.18 |
| 预提信息披露费 | 94,219.55 |
| 预提上市年费 | 29,752.78 |
| 合计 | 158,706.67 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 540,897,469.79 | 392,892,807.32 |
| 本期申购 | 183,831,974.14 | 133,541,063.03 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -551,469,072.45 | -400,575,351.51 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 173,260,371.48 | 125,858,518.84 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 上年度末 | 163,606,240.66 | -3,227,200.88 | 160,379,039.78 |
| 本期利润 | -1,345,851.01 | 6,968,238.47 | 5,622,387.46 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -112,713,329.79 | 1,556,017.78 | -111,157,312.01 |
| 其中：基金申购款 | 55,779,663.22 | -268,376.83 | 55,511,286.39 |
| 基金赎回款 | -168,492,993.01 | 1,824,394.61 | -166,668,598.40 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 49,547,059.86 | 5,297,055.37 | 54,844,115.23 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| | 活期存款利息收入 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 56,844.54 |
| 其他 | 4,185.24 |
| 合计 | 75,773.35 |

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期末未进行股票投资。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 682,437,581.55 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 675,727,261.64 |
| 减：应收利息总额 | 17,657,322.01 |
| 买卖债券差价收入 | -10,947,002.10 |

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末未进行权证投资。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|--------------------------------|
| 国债期货投资收益 | - |
| 股指期货-投资收益 | - |

本基金本报告期末未进行其他衍生工具投资。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收入。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 6,968,238.47 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 6,968,238.47 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 6,968,238.47 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 24,624.34 |
| 合计 | 24,624.34 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 交易所市场交易费用 | 7,343.10 |
| 银行间市场交易费用 | 600.00 |
| 合计 | 7,943.10 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|--------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 34,712.18 |
| 信息披露费 | 94,219.55 |
| 上市年费 | 29,752.78 |
| 银行汇划费用 | 1,610.49 |
| 其他费用 | 300.00 |

| | |
|-------|------------|
| 帐户维护费 | 18,000.00 |
| 合计 | 178,595.00 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------|-----------------|
| 东吴基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 东吴证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

注：本报告期基金关联方未发生变化。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间 2016年4月26日(基金转型生效日)至 2016年6月30日 |
|-------|----------------------------|---|
|-------|----------------------------|---|

| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
|----------------|----------------|------------------|----------------|------------------|
| 东吴证券股份有 限公司 | 710,950,625.80 | 100.00% | 278,871,581.42 | 64.01% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间 2016年4月26日(基金转型生效日)至 2016年6月30日 | |
|----------------|----------------------------|--------------------|---|------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的比例 |
| 东吴证券股份有 限公司 | 3,923,642,000.00 | 100.00% | 316,794,000.00 | 15.49% |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月 30日 | 上年度可比期间 2016年4月26日(基金转型生效日) 至2016年6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付 的管理费 | 1,370,589.65 | 590,486.15 |
| 其中：支付销售机构的客 户维护费 | 310,853.00 | 92,266.94 |

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.7% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间 2016年4月26日(基金转型生效 日)至2016年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 391,597.03 | 168,710.31 |

注：支付基金托管人中国交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费 各关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 东吴证券股份有限公司 | 1,615.29 |
| 交通银行股份有限公司 | 15,042.83 |
| 东吴基金管理有限公司 | 323,892.14 |
| 合计 | 340,550.26 |
| 获得销售服务费 各关联方名称 | 上年度可比期间 2016年4月26日(基金转型生效日)至2016年6 月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 东吴证券股份有限公司 | 28,389.49 |
| 交通银行股份有限公司 | 3,505.35 |
| 东吴基金管理有限公司 | 195,039.74 |
| 合计 | 226,934.58 |

注：本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。

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35%年费率计提。

其计算方法为：基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------------------|----------------------|--------------------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 2016年4月26日(基金转型生效日)至2016年6月30日 |
| 基金转型生效日(2016年4月26日)持有的基金份额 | 56,274,780.35 | 56,274,780.35 |
| 期初持有的基金份额 | 2,000,000.00 | 56,274,780.35 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | - | 25,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额 | 2,000,000.00 | 31,274,780.35 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.1500% | 1.1500% |

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|----------|----------------------|-----------|--------------------------------|-----------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 2016年4月26日(基金转型生效日)至2016年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 活期存款利息收入 | 1,426,310.53 | 14,743.57 | 5,940,283.72 | 38,828.21 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时性停牌而流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，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债券、货币市场工具、银行存款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相关规定），不能参与一级市场新股申购，也不能在二级市场上投资股票、权证等权益类资产。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

本基金为纯债基金，在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过对债券组合久期、期限结构、债券品种的主动式管理，力争提供稳健的投资收益。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由合规风控部负责，组织、协调并与其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。合规风控部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他应收类款项。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金管理人的投资部门及交易部门建立了经审批的交易对手名单，并通过限定被投资对象的信用等级范围及各类投资品种比例来管理信用风险。本基金

的银行存款存放于本基金的托管行 - 交通银行股份有限公司。本基金认为与交通银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。作为开放式基金，存在兑付赎回资金的流动性风险。本基金流动风险亦来源于因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的

基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的合规风控部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余部分在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金资产净值的 40%。

除卖出回购金融资产款合约约定到期日均为一个月以内计息外，本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017年 6月30日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|--------------|-------|--------|------|------|-----|--------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 1,426,310.53 | - | - | - | - | - | 1,426,310.53 |
| 清算备付金 | 2,262,688.28 | - | - | - | - | - | 2,262,688.28 |
| 存出保证金 | 63,663.16 | - | - | - | - | - | 63,663.16 |

| | | | | | | | |
|----------|---------------|--------------|---------------|----------------|--------------|--------------|----------------|
| 交易性金融资产 | 3,000,000.00 | 9,891,383.15 | 25,878,799.03 | 112,109,406.50 | 4,631,384.80 | - | 155,510,973.48 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 19,400,000.00 | - | - | - | - | - | 19,400,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 1,418,362.48 | 1,418,362.48 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 3,464,407.09 | 3,464,407.09 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 129,109.25 | 129,109.25 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|-----------|---------------|--------------|---------------|----------------|--------------|--------------|----------------|
| 产 | | | | | | | |
| 资产总计 | 26,152,661.97 | 9,891,383.15 | 25,878,799.03 | 112,109,406.50 | 4,631,384.80 | 5,011,878.82 | 183,675,514.27 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 1,736,874.25 | 1,736,874.25 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 868,069.22 | 868,069.22 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 116,374.76 | 116,374.76 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 33,249.93 | 33,249.93 |
| 应付销售 | - | - | - | - | - | 58,187.38 | 58,187.38 |

| | | | | | | | |
|----------------------|---------------|--------------|---------------|----------------|--------------|--------------|----------------|
| 服务费 | | | | | | | |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 693.93 | 693.93 |
| 应交税金 | - | - | - | - | - | 724.06 | 724.06 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 158,706.67 | 158,706.67 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 2,972,880.20 | 2,972,880.20 |
| 利率敏感度缺口 | 26,152,661.97 | 9,891,383.15 | 25,878,799.03 | 112,109,406.50 | 4,631,384.80 | 2,038,998.62 | 180,702,634.07 |
| 上年度末 2016年 12月 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|----------------|---|---|----------------|
| 31日 | | | | | | | |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 3,636,962.96 | - | - | - | - | - | 3,636,962.96 |
| 清算备付金 | 17,662,172.48 | - | - | - | - | - | 17,662,172.48 |
| 存出保证金 | 60,608.36 | - | - | - | - | - | 60,608.36 |
| 交易性金融资产 | 41,500,000.00 | 10,173,343.30 | 66,778,344.15 | 583,850,462.10 | - | - | 702,302,149.55 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---------------|---------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 算款 | | | | | | | |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 16,815,665.75 | 16,815,665.75 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 563,148.76 | 563,148.76 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 62,859,743.80 | 10,173,343.30 | 66,778,344.15 | 583,850,462.10 | - | 17,378,814.51 | 741,040,707.86 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购证券款 | 180,830,000.00 | - | - | - | - | - | 180,830,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 2,625,605.11 | 2,625,605.11 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 3,177,034.03 | 3,177,034.03 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---|---|--------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 482,179.36 | 482,179.36 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 137,765.53 | 137,765.53 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 241,089.68 | 241,089.68 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 2,825.00 | 2,825.00 |
| 应交税金 | - | - | - | - | - | 724.06 | 724.06 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 10,985.75 | 10,985.75 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 260,652.24 | 260,652.24 |
| 负债总计 | 180,830,000.00 | - | - | - | - | 6,938,860.76 | 187,768,860.76 |

| | | | | | | | |
|----------|-----------------|---------------|---------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 计 | | | | | | | |
| 利率敏感程度缺口 | -117,970,256.20 | 10,173,343.30 | 66,778,344.15 | 583,850,462.10 | - | 10,439,953.75 | 553,271,847.10 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。 | | |
| | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 | | |
| | 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2017 年 6 月 30 日） | 上年度末（2016 年 12 月 31 日） |
| | 利率下降 25 个基点 | 835,930.82 | 4,219,319.28 |
| | 利率上升 25 个基点 | -827,648.88 | -4,174,219.09 |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。

本基金管理人合规风控部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准 | | |
|----|------------------------------------|------------------------------|---------------------------|
| | 选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元) | |
| | | 本期末 (2017 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2016 年 12 月 31 日) |
| | 1. 业绩基准下跌 1% | -325,264.74 | -3,558,644.52 |
| | 2. 业绩基准下跌 5% | -1,626,323.71 | -17,793,222.60 |
| | 3. 业绩基准下跌 10% | -3,252,647.41 | -35,586,445.21 |

注:报告期内,本基金 2017 年 beta 值为 0.18,2016 年为 0.64。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 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 | 155,510,973.48 | 84.67 |
| | 其中：债券 | 155,510,973.48 | 84.67 |
| | 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 | 19,400,000.00 | 10.56 |
| | 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 | 3,688,998.81 | 2.01 |
| 7 | 其他各项资产 | 5,075,541.98 | 2.76 |
| 8 | 合计 | 183,675,514.27 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 15,520,994.80 | 8.59 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 128,889,278.68 | 71.33 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 10,050,000.00 | 5.56 |
| 7 | 可转债 (可交换债) | 1,050,700.00 | 0.58 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 155,510,973.48 | 86.06 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 (张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 136192 | 16 信威 01 | 405,170 | 39,694,504.90 | 21.97 |
| 2 | 101554069 | 15 喀斯特旅 MTN001 | 100,000 | 10,050,000.00 | 5.56 |
| 3 | 112393 | 16 万维 01 | 100,000 | 10,023,000.00 | 5.55 |
| 4 | 019546 | 16 国债 18 | 99,000 | 9,889,110.00 | 5.47 |
| 5 | 112466 | 16 彩塑 01 | 100,000 | 9,814,000.00 | 5.43 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注**7.11.1**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|----|----|
|----|----|----|

| | | |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 63,663.16 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,418,362.48 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,464,407.09 |
| 5 | 应收申购款 | 129,109.25 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,075,541.98 |

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 3,839 | 45,131.64 | 56,839,782.10 | 32.81% | 116,420,589.38 | 67.19% |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额 (份) | 占上市总份额 比例 |
|----|--|--------------|--------------|
| 1 | 中国太平洋人寿保险股份有 限公司 - 传统 - 普通保险产 品 | 5,000,778.00 | 36.27% |
| 2 | 中国太保集团股份有限公司 - 本级 - 集团自有资金 -012G-ZY001 | 2,800,497.00 | 20.31% |
| 3 | 长江金色交响 (集合型) 企 业年金计划 - 交通银行股份 有限公司 | 393,568.00 | 2.85% |
| 4 | 李新龙 | 376,314.00 | 2.73% |
| 5 | 中国国际金融 (香港) 有限公 司 - 中金人民币固定收益基 金 | 300,000.00 | 2.18% |
| 6 | 蔡健新 | 250,000.00 | 1.81% |
| 7 | 彭贺章 | 200,020.00 | 1.45% |
| 8 | 杨兴中 | 200,000.00 | 1.45% |
| 9 | 徐船 | 196,365.00 | 1.42% |
| 10 | 太平人寿保险有限公司 | 194,596.00 | 1.41% |

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|-------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员 | 3,988.04 | 0.0023% |

| | | |
|-------|--|--|
| 持有本基金 | | |
|-------|--|--|

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

注：高管持有本基金份额在 0~10 万份之间，本基金经理本期末未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|----------------|
| 基金转型生效日（2016 年 4 月 26 日）基金份额总额 | 537,286,206.33 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 540,897,469.79 |
| 本报告期基金总申购份额 | 183,831,974.14 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 551,469,072.45 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 173,260,371.48 |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无相关诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期新增 2 个交易单元：中金公司。退租 1 个交易单元：华创证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东吴证券 | 710,950,625.80 | 100.00% | 3,923,642,000.00 | 100.00% | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|---------------------------------------|-----------------|
| 1 | 东吴基金管理有限公司管理的基金 2016 年年度资产净值公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 1 月 3 日 |
| 2 | 东吴鼎利债券型证券投资基金 (LOF) 2016 年第 4 季度报告 | 中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 1 月 21 日 |
| 3 | 东吴鼎利债券型证券投资基金 (LOF) 2016 年年度报告以及摘要 | 中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 3 月 27 日 |
| 4 | 东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 4 月 12 日 |
| 5 | 东吴基金管理有限公司关于参加奕丰金融服务（深圳）有限公司费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 4 月 12 日 |

| | | | |
|----|--|---------------------------------------|-----------------|
| | | 网) | |
| 6 | 东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 4 月 14 日 |
| 7 | 东吴基金管理有限公司关于参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 4 月 14 日 |
| 8 | 东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）2017 年第 1 季度报告 | 中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 4 月 24 日 |
| 9 | 东吴基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 6 月 7 日 |
| 10 | 东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书以及摘要 | 中国证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网） | 2017 年 6 月 8 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|--------------------------|---------------|------|---------------|------------|------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20170105-20170110 | 98,516,382.54 | - | 98,516,382.54 | 0.00 | 0.00 |
| | 2 | 20170215-20170511 | 98,516,382.54 | - | 98,516,382.54 | 0.00 | 0.00 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 如开放期内上述持有人集中大额赎回，极端情况下本基金可能存在一定的流动性风险以及净值波动等情况。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴鼎利分级债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴鼎利分级债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴鼎利分级债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司

2017年8月25日