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）
2016 年第 2 季度报告

2016 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

报告送出日期：二〇一六年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2016 年 7 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	东吴鼎利（LOF）
场内简称	-
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
报告期末基金份额总额	460,478,884.15 份
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。
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

转型前：

基金简称	东吴鼎利分级债券
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）
基金合同生效日	2013 年 4 月 25 日
报告期末基金份额总额	537,286,206.33 份
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。
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

下属分级基金的基金简称	鼎利优先	鼎利进取
下属分级基金的场内简称	鼎利优先	鼎利进取
下属分级基金的交易代码	165808	150120
报告期末下属分级基金的份额总额	0 份	0 份
下属分级基金的风险收益特征	鼎利 A 份额将表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。	鼎利 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

注：上表中“报告期末”为 2016 年 4 月 25 日。东吴鼎利分级债券型证券投资基金根据《基金合同》的有关规定，《基金合同》生效后 3 年分级运作期届满进行转换，转换基准日为 2016 年 4 月 25 日，转换日日终，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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	转型后
	报告期（ 2016 年 4 月 26 日 － 2016 年 6 月 30 日 ）
1.本期已实现收益	5,519,679.64
2.本期利润	4,496,709.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0096
4.期末基金资产净值	464,919,010.46
5.期末基金份额净值	1.010

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	转型前
	报告期（ 2016 年 4 月 1 日 － 2016 年 4 月 25 日 ）
1.本期已实现收益	1,946,993.14
2.本期利润	-1,590,683.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0034
4.期末基金资产净值	537,286,208.54
5.期末基金份额净值	1.000

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

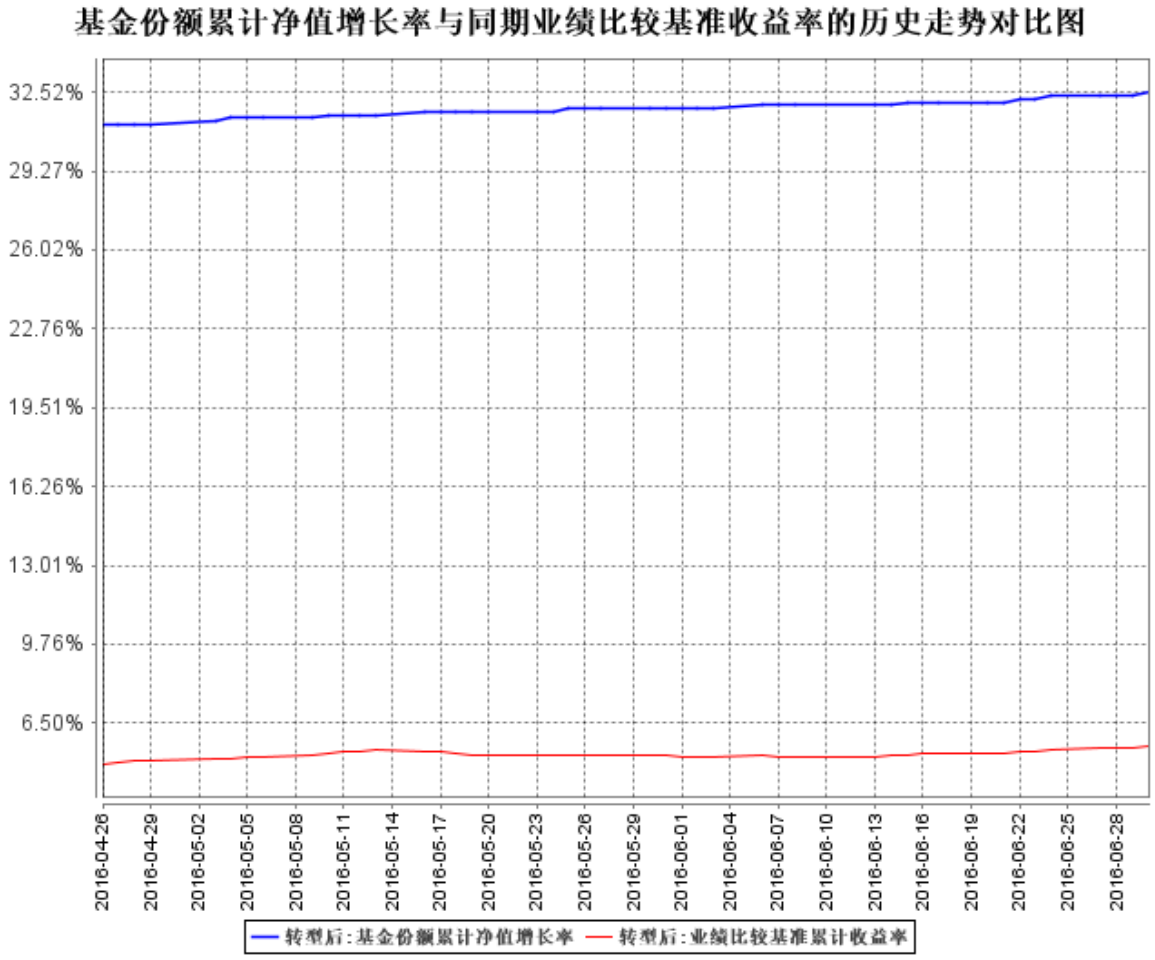
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期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
过去三个月	1.00%	0.04%	0.70%	0.04%	0.30%	0.00%

注：比较基准=中国债券综合全价指数。

3.2.2 自基金转型以来基金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



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 2016 年 6 月 30 日；自本基金转型起至报告期末不满一年。

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。

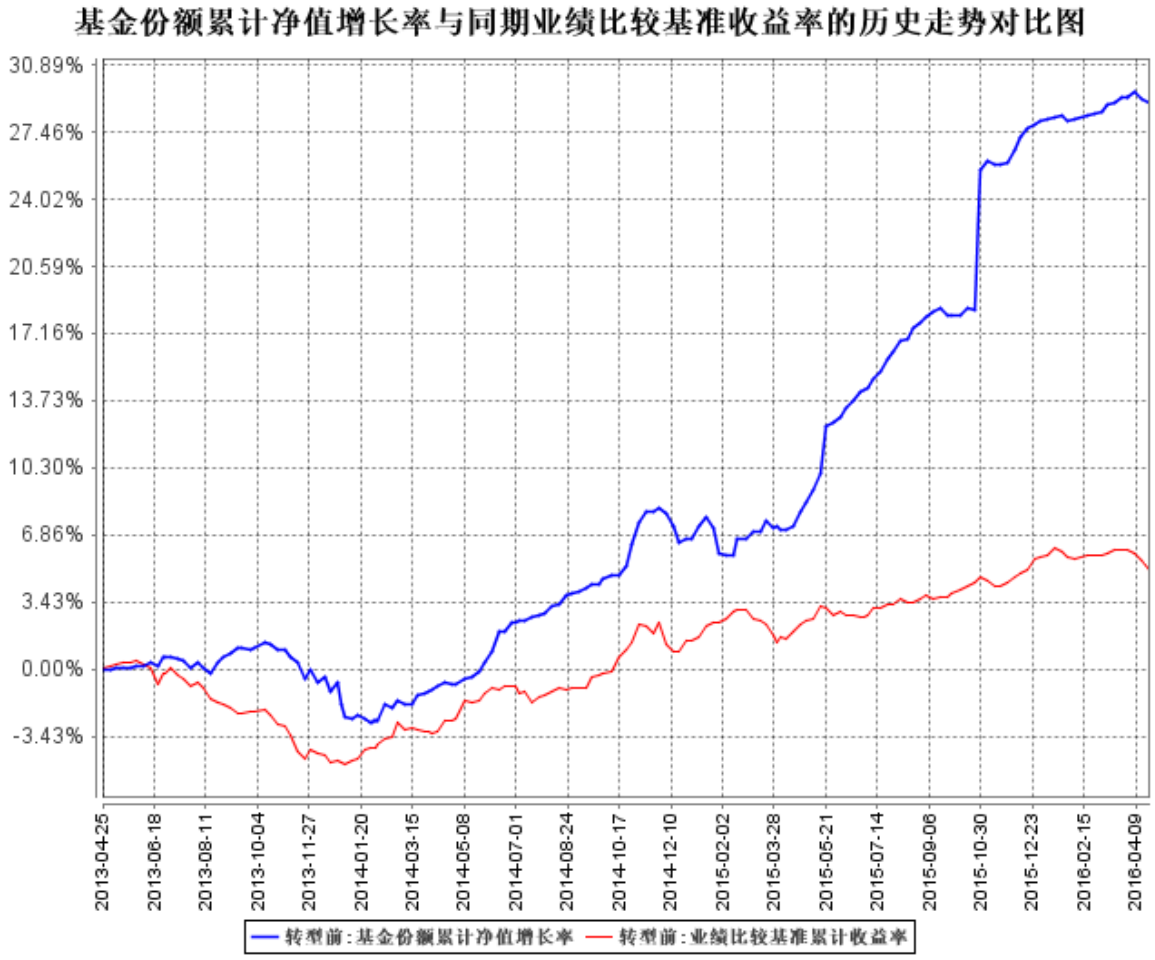
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期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
过去三个月	1.49%	0.44%	-1.21%	0.09%	2.70%	0.35%

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



注：1、比较基准=中国债券综合全价指数。

2、本基金于 2013 年 4 月 25 日成立，图示日期为 2013 年 4 月 25 日至 2016 年 4 月 25 日（转型前）。

3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 （转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	-	10 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。
陈晨	本基金基金经理	2015 年 6 月 8 日	-	4.5 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，现任东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金经理。

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 （转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	-	10 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	-	4.5 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，现任东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金经理。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度权威人士定调中国经济“L”型走势，从已发布的 4-5 月经济数据来看，工业生产仍弱，投资小幅下滑，地产和基建仍是维持投资增速的主要力量。海外来看，全球经济低迷，各经济体政治经济的博弈因素增加，不确定性加大。货币政策方面，今年货币政策整体稳健，央行主要以公开市场操作及定向工具进行流动性调节，在去杠杆要求及人民币贬值压力下，货币政策愈发两难，2.25%的 7 天期逆回购利率尚未调整。

融资需求疲弱环境下，资金面整体平稳，2 季度末的资金紧张也很快得到缓解。4 月受信用风险事件影响，市场恐慌情绪严重，固定收益类产品受到资金赎回的负面影响，债市整体快速下跌，5 月恐慌情绪逐步缓解后，债市在配置压力下收益率重新转为下行。目前 10 年期国债收益率位于 2.80%左右的历史低位水平。

本基金在报告期内顺利完成了基金转型，保持中性的债券仓位与久期，适度参与可转债一级市场申购，实现了较好收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.010 元，累计净值 1.306 元；本报告期内本基金转型前份额净值增长率 1.49%，同期业绩比较基准收益率为-1.21%，转型后份额净值增长率 1.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

转型后：

5.1 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	584,454,509.06	85.22

	其中：债券	584,454,509.06	85.22
	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	-	-
	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	8,122,462.48	1.18
8	其他资产	93,272,318.16	13.60
9	合计	685,849,289.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

5.3 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。

5.4 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	24,784,572.60	5.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,638,000.00	4.44
	其中：政策性金融债	20,638,000.00	4.44
4	企业债券	308,110,621.39	66.27
5	企业短期融资券	150,143,000.00	32.29
6	中期票据	60,434,000.00	13.00
7	可转债（可交换债）	311,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	20,033,315.07	4.31
10	合计	584,454,509.06	125.71

5.5 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	011699934	16 皖山鹰 SCP003	400,000	40,024,000.00	8.61
2	112157	12 科陆 01	218,780	22,315,560.00	4.80
3	124375	13 鄂供销	200,010	20,793,039.60	4.47
4	101581003	15 华西能源 MTN001	200,000	20,396,000.00	4.39
5	122212	12 京江河	200,000	20,180,000.00	4.34

注：组合持仓中小企业私募债及私募债情况

代码	名称	持仓数量	票面利率（%）	期限（年）
125178	13 徐水务	200000	9.5	3

5.6 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。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	60,985.14
2	应收证券清算款	78,042,780.67
3	应收股利	-
4	应收利息	11,065,647.62
5	应收申购款	4,070,338.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,566.42
8	其他	-
9	合计	93,272,318.16

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 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。

转型前：

5.1 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	507,419,277.67	88.77
	其中：债券	507,419,277.67	88.77

	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	20,000,000.00	3.50
	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	30,677,437.02	5.37
8	其他资产	13,511,810.52	2.36
9	合计	571,608,525.21	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

5.3 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。

5.4 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	14,802,640.00	2.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,804,000.00	3.87
	其中：政策性金融债	20,804,000.00	3.87
4	企业债券	319,608,134.60	59.49
5	企业短期融资券	110,214,000.00	20.51
6	可转债（可交换债）	1,811,188.00	0.34
7	同业存单	-	-
8	其他	20,033,315.07	3.73
9	合计	507,419,277.67	94.44

5.5 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	124375	13 鄂供销	400,010	41,905,047.60	7.80
2	122642	PR 朝阳债	300,000	24,717,000.00	4.60
3	122641	PR 武城投	280,190	21,386,902.70	3.98

4	122805	PR 大同债	295,000	21,015,800.00	3.91
5	150210	15 国开 10	200,000	20,804,000.00	3.87

注：组合持仓中小企业私募债及私募债情况

代码	名称	持仓数量	票面利率（%）	期限（年）
125178	13 徐水务	200000	9.5	3

5.6 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。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	79,552.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,432,258.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,511,810.52

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金转型起始日（ 2016 年 4 月 26 日 ）基金份额总额	537,286,206.33
基金转型起始日至报告期末基金总申购份额	184,225,146.64
减：基金转型起始日至报告期末基金总赎回份额	261,032,468.82
基金转型起始日至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	460,478,884.15

注：报告周期为 2016 年 4 月 26 日到 2016 年 6 月 30 日。

6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	鼎利优先	鼎利进取
报告期期初基金份额总额	39,803,809.70	424,416,720.09
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	33,538,878.74	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-6,264,930.96	-424,416,720.09
报告期期末基金份额总额	0	0

注：报告周期为 2016 年 4 月 1 日到 2016 年 4 月 25 日。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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	56,274,780.35
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	25,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	31,587,528.15
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	6.86

注：报告周期为 2016 年 4 月 26 日至 2016 年 6 月 30 日。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2016 年 5 月 27 日	25,000,000.00	25,125,000.00	0.00%
合计			25,000,000.00	25,125,000.00	

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	45,026,325.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	56,274,780.35
报告期期末持有的本基金份额占基金总份	10.47

额比例（%）	

注：报告周期为 2016 年 4 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日。因基金分级运作期届满进行转换，基金管理人持有东吴鼎利进取份额 45,026,325.00 份，根据转换比例，转换后持有东吴鼎利（LOF）份额 56，274，780.35 份。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金《基金合同》中相关约定，本基金已于 3 年分级运作周期届满（2016 年 4 月 25 日）后转型为上市开放式基金（LOF）。转型后东吴鼎利（LOF）已于 2016 年 5 月 6 日开通申购、赎回等业务，并于 2016 年 5 月 20 日在深圳证券交易所挂牌交易。投资者欲了解相关信息，请查询基金管理人在指定媒介披露的相关公告及届时更新的《招募说明书》中相关内容。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

9.3 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

2016 年 7 月 20 日