

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 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月二十七日

§1 重要提示

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 3 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。

根据《东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》的约定，基金分级运作周期届满，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），2016 年 4 月 26 日东吴鼎利分级债券型证券投资基金正式更名为“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本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 4 月 25 日止，东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）本报告期自 2016 年 4 月 26 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（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	契约型。 基金合同生效日起 3 年内，鼎利 A 每满 6 个月开放一次，接受申购、赎回，第六个开放日只接受赎回，不接受申购；鼎利 B 封闭运作并上市交易。鼎利 A 和鼎利 B 的基金资产合并运作。 基金分级运作周期届满后，本基金转型为上市开放式基金（LOF）	
基金合同生效日	2013 年 4 月 25 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	537,286,206.33 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	2013 年 6 月 25 日	
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

注：1、《基金合同》生效之日起 3 年内，深圳证券交易所上市交易并封闭运作的基金份额简称为鼎利进取。

2、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。

2.1 基金基本情况（转型后）

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	540,897,469.79 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（转型前）

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。	
	鼎利优先	鼎利进取
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。

2.2 基金产品说明（转型后）

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：基金管理人于 2016 年 2 月 3 日发布法定代表人变更公告，经工商行政管理部门核准，法定代表人变更为王炯先生。

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年 1 月 1 日-2016 年 12 月 31 日		2015 年	2014 年
	转型前	转型后		
本期已实现收益	8,040,800.15	24,087,275.81	83,771,336.57	29,268,601.14
本期利润	3,904,224.68	12,476,734.14	90,611,173.43	61,056,024.65
加权平均基金份额本期利润	0.0084	0.0165	0.1426	0.0816
本期基金份额净值增长率	2.48%	2.30%	20.00%	8.58%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2711	0.2965	0.2965	0.0736
期末基金资产净值	537,286,208.54	553,271,847.10	566,920,862.60	737,483,930.46
期末基金份额净值	1.000	1.023	1.221	1.033

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（转型前）

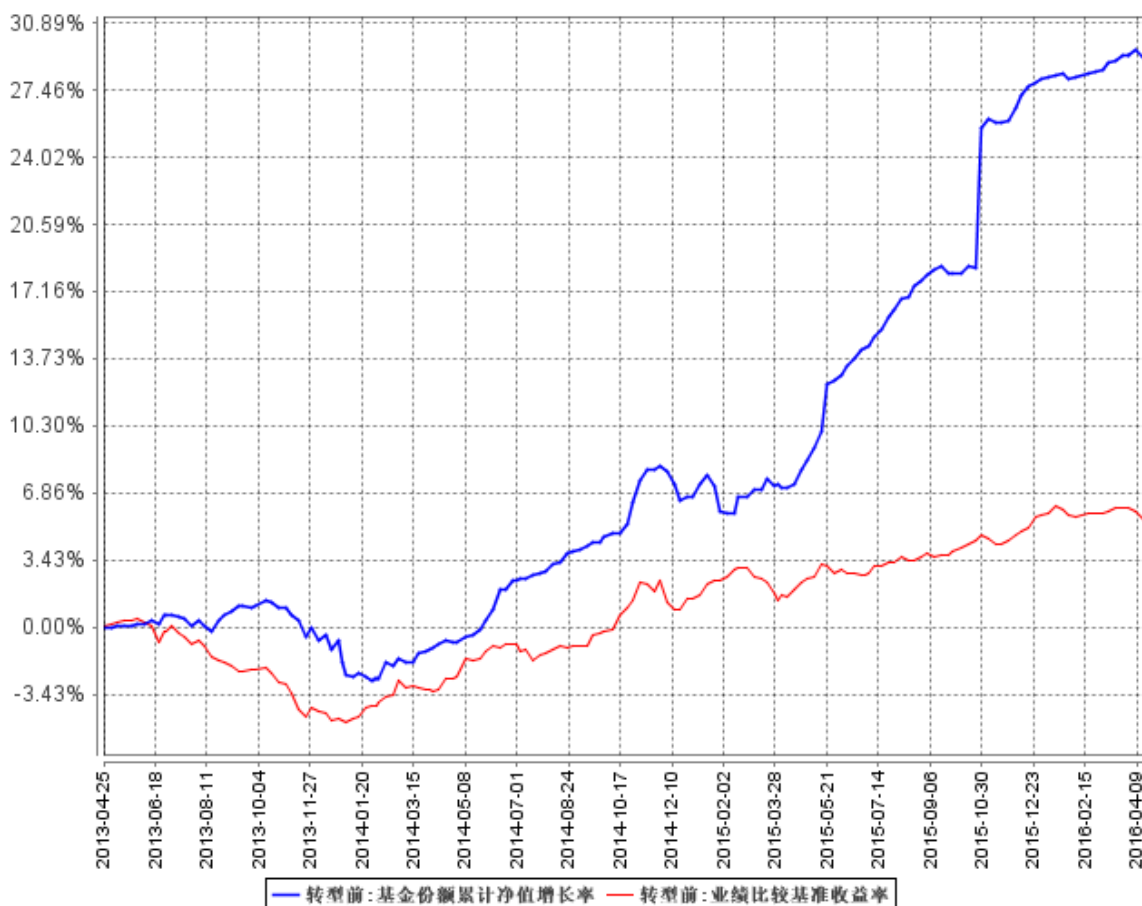
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型前						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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 2016/4/1- 2016/4/25	1.49%	0.44%	-1.21%	0.09%	2.70%	0.35%
过去六个月 2016/1/1- 2016/4/25	2.48%	0.20%	-0.91%	0.08%	3.39%	0.12%
过去一年 2015/7/1- 2016/4/25	14.80%	0.38%	2.02%	0.08%	12.78%	0.30%
过去三年 2013/7/1- 2016/4/25	30.42%	0.25%	5.00%	0.10%	25.42%	0.15%
自基金合同生效起至 今 2013/4/25- 2016/4/25	31.21%	0.25%	4.78%	0.10%	26.43%	0.15%

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



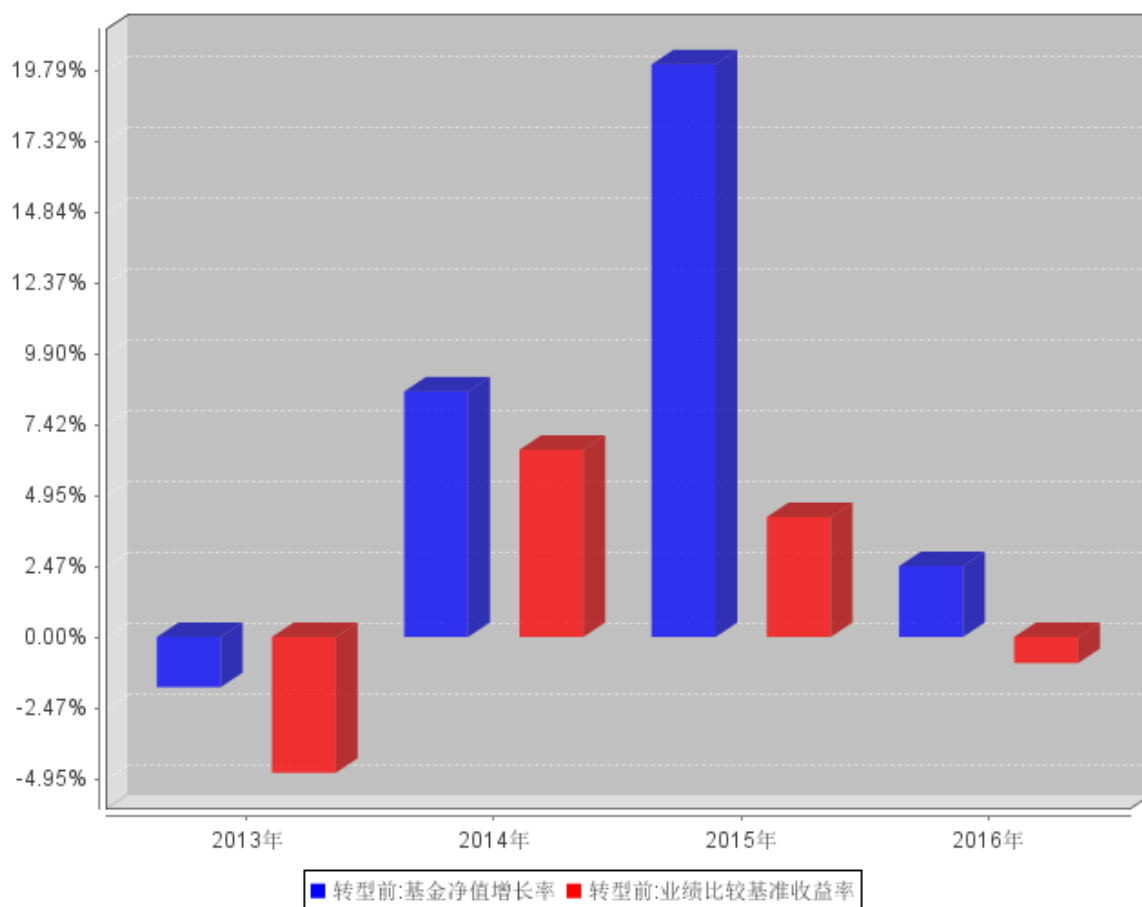
注：1、本基金合同于 2013 年 4 月 25 日生效，本基金于 2016 年 4 月 25 日三年封闭届满，封闭期届满后基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）”，封闭期届满日为本基金份额转换基准日。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3、比较基准=中国债券综合全价指数。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1. 本基金合同生效日为2013年4月25日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2. 本基金于2016年4月26日进行了转型，2016年数据为2016年1月1日至2016年4月25日的数据。

3.2 基金净值表现（转型后）

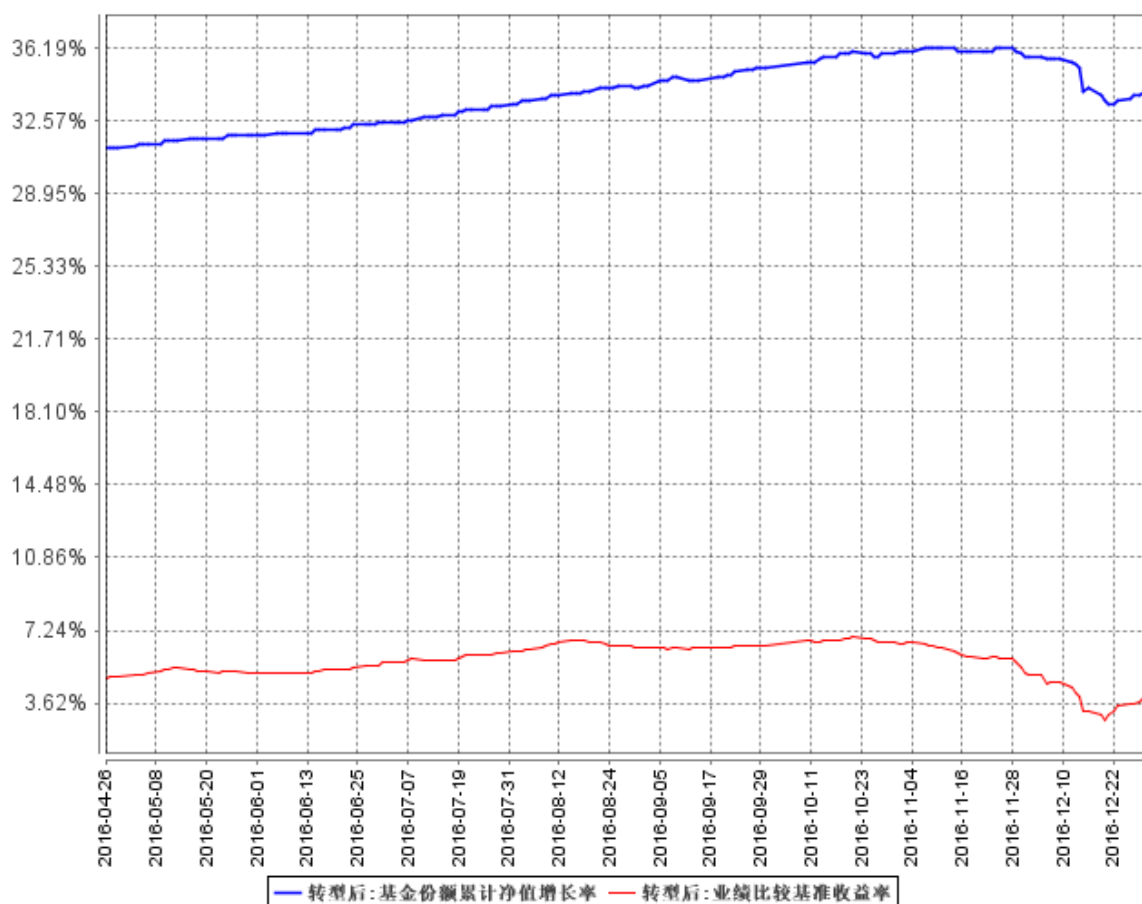
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	转型后				①—③	②—④
	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④		
过去三个月	-0.78%	0.14%	-2.32%	0.15%	1.54%	-0.01%
过去六个月	1.29%	0.11%	-1.42%	0.11%	2.71%	0.00%
自基金转型生效起至今 (2016/04/26-2016/12/31)	2.30%	0.09%	-0.73%	0.10%	3.03%	-0.01%

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



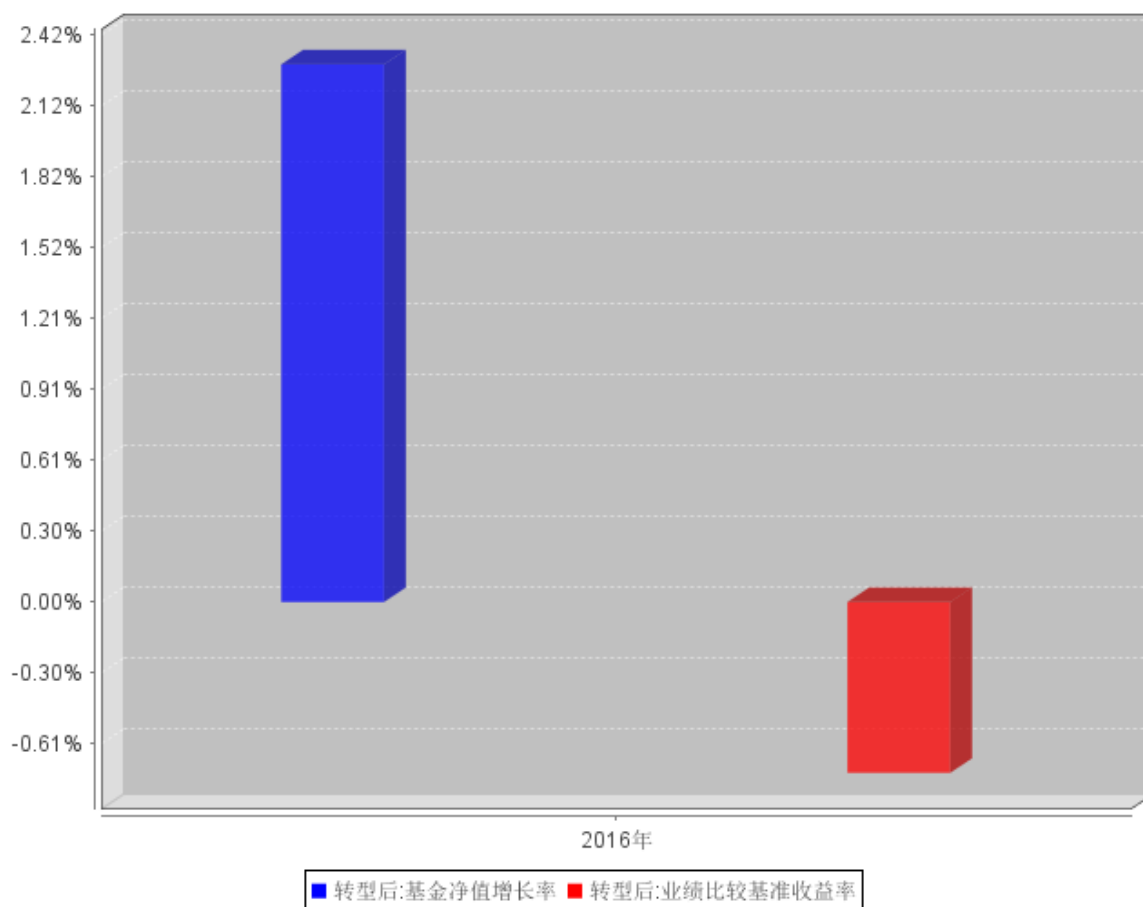
注：1、比较基准=中国债券综合全价指数。

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 2016 年 12 月 31 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。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2016 年 4 月 26 日进行了转型，2016 年度数据为 2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

过去三年未进行过利润分配。

转型后

本基金自转型起未进行利润分配。

§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、资产管理和经中国证监会批准的其他业务。

公司自成立以来，始终坚守“待人忠、办事诚、以德兴业”的东吴文化，追求为投资者奉献可持续的长期回报。近年来，在泛资管大背景下，公司推进公募基金、专户业务以及子公司业务协同发展，尤其在公募及专户领域大刀阔斧地进行了事业部制改革和平台化战略尝试，进一步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 2016 年 12 月 31 日，公司整体资产管理规模为 631.46 亿元，其中公募基金 148.47 亿元，专户业务 101.51 亿元，子公司 381.48 亿元；旗下管理着 25 只公募基金，33 只存续专户资产管理计划，101 只存续专项资产管理计划（子公司），涵盖了高中低不同风险层次的多元化产品线，可满足不同类型投资者的投资需求。

2015 年以来，公司在成长股投资的传统优势基础上，进一步引入了量化投资策略，并在业内率先成立了绝对收益部，谋求穿越牛熊的正回报。目前已发行多只量化公募产品，其中东吴安盈量化基金、东吴安鑫量化基金为“量化策略+全市场选股”；东吴智慧医疗基金为“量化策略+热门主题”。从实战检验角度看，该系列基金经受住了市场反复震荡的考验，尤其在严控回撤、优化收益方面成效显著，初步实现了“下跌时回撤小，上涨时不掉队”的目标。

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，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，兼顾流动性与收益率，为大类资产配置提供基础性工具。

2016 年，公司的固定收益投资能力跃居行业“第一梯队”。据海通证券 2016 年基金公司固定收益投资能力排行榜显示，东吴基金固收团队以 3.81%的综合收益率，位列 85 家入选基金公司的第六位。

近年来，公司凭借扎实的投资团队、出色投资业绩，斩获了诸多奖项，比如 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）、2015 年度十大风云基金公司（《大众证券报》）、2014 年度最佳投资风格*金蝉奖（东吴新经济股票型基金，《华夏理财》杂志）、2014 年度新财富最智慧投资机构（《新财富》杂志）等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	2013 年 6 月	-	11 年	博士，上海交通大学

	益部总经理、本基金基金经理	25 日			管理专业毕业。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 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 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。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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 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 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，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2016 年开年经济悲观预期强烈，春节后经济托底预期上升，随后 2 季度权威人士定调中国经济“L”型走势，全年经济保持低位平稳，GDP 同比增速录得 6.7%。从固定资产投资来看，基建投资继续发挥托护作用，始自 2015 年的房地产政策放松带动地产投资增速小幅回升，下半年主动补库存阶段带动制造业投资低位回升。全年通胀保持低位，CPI 月度同比增速位于 1.3%-2.3%之间，但受国际油价回升以及国内供给侧改革带动，9 月 PPI 同比增速结束了持续 54 个月

的负增，并在 4 季度大幅回升。2016 年新增社会融资总量 17.8 万亿，新增信贷规模 12.4 万亿，有利的融资环境对经济企稳发挥了重要作用。

货币政策方面，2 月份在经济下滑压力较大、外汇占款持续流出及年初以来权益市场急速下挫的背景下，央行下调一次法定存款准备金率。2016 年外汇占款累计流出 2.9 万亿，基础货币负增，但受制于国内资产价格高企，以及全球货币政策转向的国际环境，央行仅以公开市场和定向工具进行流动性投放，并于 3 季度重启较长期限的逆回购操作，逐步拉长定向操作工具期限，政策基调趋于收紧。在 3 季度及 4 季度货币政策执行报告中也明确了防风险、去杠杆的政策重心。监管政策方面，随着理财大发展以及银行负债结构的转变，央行重提将表外理财纳入 MPA 广义信贷指标，并将加强对同业存单等负债品种的监管。

债券市场来看，年初利率债收益率快速下行至历史低位，4 月受信用风险事件影响，固定收益类产品被大量赎回触发债市快速下跌，5 月恐慌情绪逐步缓解后，配置压力下收益率重新转为下行。3 季度利率债窄区间波动，收益率最低点在 7 月较弱的经济金融数据发布前达到，随后央行重启较长期限逆回购操作使得货币政策宽松预期明显降低，收益率有所上行，信用债则在强大的资产配置需求下表现为信用利差与期限利差双双收窄；11 月特朗普当选后触发债券市场大幅调整，12 月央行流动性投放不足导致资金面持续紧张，央行监管政策收紧以及相关机构的负面信息对市场情绪形成明显打压，债券市场出现踩踏，债券收益率超大幅上行。

2016 年本基金顺利完成转型，保持中性杠杆和久期水平，并适度参与可转债一级市场申购，实现了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日（2016 年 04 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日），本基金份额净值为 1.023 元，累计净值 1.319 元；本报告期份额净值增长率 2.30%，同期业绩比较基准收益率为-0.73%。

截至 2016 年 4 月 25 日（2016 年 01 月 01 日至 2016 年 04 月 25 日），本基金份额净值为 1.000 元，累计净值 1.296 元；本报告期份额净值增长率 2.48%，同期业绩比较基准收益率为-0.91 %。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然中国经济已基本脱离失速风险，但经济结构并未有明显转变，仍然是投资作为主要支撑，尤其是对融资高度依赖的地产与基建投资。本轮补库存阶段的持续时间可能并不会很长，在下游需求难言明显好转的情况下，工业品价格上涨带来的上中游行业回暖，是否能够顺利传导至

下游，有较大疑问。而资产价格高企、金融风险抬升以及美国加息周期的开启，对央行货币政策宽松构成明显掣肘，除非经济出现明显回落风险，否则稳健中性的货币政策基调可能会贯通全年。银行委外资金作为去年最重要的债券市场新增需求力量，今年大概率会弱化，只是弱化的程度需要看具体的监管政策实施。在经历了去年末以来市场的大幅调整后，目前债券已经跌出了价值，随着后续相关监管政策的落地，预计债券需求会有所好转，流动性也将明显改善。

操作策略方面，我们将灵活调整组合杠杆和久期，严控信用风险和流动性风险，力争为投资者实现良好收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持从规范运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，建立健全内部风险控制体系，完善内幕交易防控机制，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项稽核等方式，推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具相关报告。

本报告期内，本基金管理人监察稽核重点开展的工作包括：

（1）紧跟业务要求，完善风险控制手段。本基金管理人结合基金风险管理要求，事前做好系统风控设置，事中加强监控及跟踪提示，事后积极研究、探索风控手段的优化方案，规范流程，提升效率，构建多维度的风险管理层次，不断提升公司风险管理水平。

（2）以风险为导向，关键业务为重点开展专项稽核。本基金管理人找准业务重点及关键环节，抓住主要风险点，比照最新监管要求，扎实开展了多项专项稽核工作，取得了一定成效。稽核内容覆盖了多项业务领域，深入内控薄弱环节，发现问题后及时采取整改措施，化解风险隐患，加强了公司风险合规管理。

（3）梳理信批流程，促进信息披露规范化。本基金管理人持续关注最新出台的法律法规，根据产品的不同信息披露要求切实做好信息披露要点汇总、节点提示及对外披露等工作，加强流程化、日志化管理，保障了信息披露工作的及时性以及准确性。

（4）提升合规氛围，推动合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强了内部合规培训力度，深化基金从业人员风合规险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、合规风控业务相关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，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

4.9 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

2016 年，基金托管人在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）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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016 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）（原东吴鼎利分级债券型证券投资基金）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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016 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）（原东吴鼎利分级债券型证券投资基金）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 审计报告（转型前）

本报告期基金财务报告经天衡会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了天衡审字（2017）00562 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§6 审计报告（转型后）

本报告期基金财务报告经天衡会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了天衡审字（2017）00510 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：东吴鼎利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 4 月 25 日

单位：人民币元

资 产	报告期初至转型前	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		

银行存款	16,798,834.98	271,777.50
结算备付金	13,878,602.04	42,713,134.52
存出保证金	79,552.01	42,840.13
交易性金融资产	507,419,277.67	494,048,828.32
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	507,419,277.67	494,048,828.32
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	20,000,000.00	18,000,000.00
应收证券清算款	-	3,150.00
应收利息	13,432,258.51	12,700,603.78
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	571,608,525.21	567,780,334.25
负债和所有者权益	报告期初至转型前	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	211,621.06	-
应付赎回款	33,538,878.74	-
应付管理人报酬	273,665.69	334,910.85
应付托管费	78,190.20	95,688.83
应付销售服务费	136,832.84	167,455.41
应付交易费用	-	692.50
应交税费	724.06	724.06
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	82,404.08	260,000.00
负债合计	34,322,316.67	859,471.65
所有者权益：		
实收基金	390,228,113.32	423,766,992.06
未分配利润	147,058,095.22	143,153,870.54
所有者权益合计	537,286,208.54	566,920,862.60
负债和所有者权益总计	571,608,525.21	567,780,334.25

注：1. 报告截止日 2016 年 4 月 25 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 537,286,206.33

份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日。

7.2 利润表

会计主体：东吴鼎利分级债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	6,965,444.52	116,445,908.98
1. 利息收入	10,356,930.49	79,011,544.36
其中：存款利息收入	98,828.01	917,790.33
债券利息收入	10,249,862.00	78,035,115.56
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	8,240.48	58,638.47
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	745,089.50	30,594,527.76
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	745,089.50	30,594,527.76
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,136,575.47	6,839,836.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	3,061,219.84	25,834,735.55
1. 管理人报酬	1,263,471.53	4,895,673.97
2. 托管费	360,991.87	1,398,764.09
3. 销售服务费	631,735.79	2,447,836.96
4. 交易费用	3,134.38	11,674.54
5. 利息支出	679,992.74	16,727,008.37
其中：卖出回购金融资产支出	679,992.74	16,727,008.37
6. 其他费用	121,893.53	353,777.62
三、利润总额（亏损总额以	3,904,224.68	90,611,173.43

“-”号填列)		
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,904,224.68	90,611,173.43

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴鼎利分级债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 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）	423,766,992.06	143,153,870.54	566,920,862.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,904,224.68	3,904,224.68
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）	-33,538,878.74	-	-33,538,878.74
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-33,538,878.74	-	-33,538,878.74
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）	390,228,113.32	147,058,095.22	537,286,208.54
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	684,941,233.35	52,542,697.11	737,483,930.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	90,611,173.43	90,611,173.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-261,174,241.29	-	-261,174,241.29

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	65,772.86	-	65,772.86
2. 基金赎回款	-261,240,014.15	-	-261,240,014.15
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）	423,766,992.06	143,153,870.54	566,920,862.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王炯	_____ 吕晖	_____ 沈静
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

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%。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止；本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 4 月 25 日止。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期为 2016 年 1 月 1 日起至 4 月 25 日止。

7.4.4.2 记账本位币

记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债

表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金分级运作周期内的收益分配原则：

- （1）基金合同生效之日起 3 年内，不进行收益分配；
- （2）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、分级运作周期届满，转型为东吴鼎利债券基金（LOF）后的收益分配原则：

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 8 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）场外的基金份额，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资人在不同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式，如投资人在某一销售机构交易账户不选择收益

分配方式，则按默认的收益分配方式处理。场内的基金份额的分红方式为现金分红，投资人不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

（4）每一基金份额享有同等分配权；

（5）法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

（1）计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

（2）重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（a）对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

（b）对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自成立日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

（c）在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起营改增后，基金买卖股票、债券的差价收入免收增值税。

2、对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、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

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
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	135,336,260.47	42.21%	769,828,590.25	30.55%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	260,000.00	0.00%	3,551,411,000.00	3.17%

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 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。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,263,471.53	4,895,673.97
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	16,982.49	703,322.59

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 × 0.7% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	360,991.87	1,398,764.09

注：支付基金托管人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 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 4 月 25 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鼎利优先	鼎利进取	合计
东吴证券股份有限公司	-	63,529.54	63,529.54
交通银行股份有限公司	4,084.65	-	4,084.65

司			
东吴基金管理有限公司	35,989.85	484,890.57	520,880.42
合计	40,074.50	548,420.11	588,494.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鼎利优先	鼎利进取	合计
东吴证券股份有限公司	31.97	184,632.95	184,664.92
交通银行股份有限公司	575,582.15	-	575,582.15
东吴基金管理有限公司	110,968.33	1,392,945.62	1,503,913.95
合计	686,582.45	1,577,578.57	2,264,161.02

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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	45,026,325.00	45,026,325.00
期初持有的基金份额	45,026,325.00	45,026,325.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	11,248,455.35	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	56,274,780.35	45,026,325.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.61%	10.61%

注：1. 本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资东吴鼎利优先份额的情况。

2. 报告周期为 2016 年 1 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。

3. 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例中的“基金总份额”为东吴鼎利进取转换为东吴鼎利（LOF）后的总份额。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.8.5 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	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 4 月 25 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	16,798,834.98	16,321.50	271,777.50	77,703.40

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.9 期末（2016 年 4 月 25 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

§7 年度财务报表(转型后)**7.1 资产负债表（转型后）**

会计主体：东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	转型后至报告期末
资 产：	
银行存款	3,636,962.96
结算备付金	17,662,172.48
存出保证金	60,608.36
交易性金融资产	702,302,149.55
其中：股票投资	—
基金投资	—
债券投资	702,302,149.55
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
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
应收股利	—
应收申购款	563,148.76
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	741,040,707.86
负债和所有者权益	转型后至报告期末
负 债：	
短期借款	—
交易性金融负债	—
衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	180,830,000.00
应付证券清算款	2,625,605.11
应付赎回款	3,177,034.03
应付管理人报酬	482,179.36
应付托管费	137,765.53
应付销售服务费	241,089.68

应付交易费用	2,825.00
应交税费	724.06
应付利息	10,985.75
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	260,652.24
负债合计	187,768,860.76
所有者权益：	
实收基金	392,892,807.32
未分配利润	160,379,039.78
所有者权益合计	553,271,847.10
负债和所有者权益总计	741,040,707.86

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.023 元，基金份额总额 540,897,469.79 份。

2、本财务报表的实际编辑期间为 2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日。

7.2 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：2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	21,946,576.90
1. 利息收入	32,623,077.85
其中：存款利息收入	262,479.38
债券利息收入	32,289,454.26
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	71,144.21
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	740,252.43
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	740,252.43
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-11,610,541.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	193,788.29

减：二、费用	9,469,842.76
1. 管理人报酬	3,717,996.98
2. 托管费	1,062,284.84
3. 销售服务费	1,858,998.50
4. 交易费用	28,783.12
5. 利息支出	2,562,281.56
其中：卖出回购金融资产支出	2,562,281.56
6. 其他费用	239,497.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	12,476,734.14
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	12,476,734.14

7.3 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：2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	12,476,734.14	12,476,734.14
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）	2,664,694.00	844,210.42	3,508,904.42
其中：1. 基金申购款	1,045,204,494.43	430,317,866.92	1,475,522,361.35
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,042,539,800.43	-429,473,656.50	-1,472,013,456.93
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）	392,892,807.32	160,379,039.78	553,271,847.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王炯	吕晖	沈静
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止；本报告期自 2016 年 4 月 26 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变

动分别于交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金分级运作周期内的收益分配原则：

- （1）基金合同生效之日起 3 年内，不进行收益分配；
- （2）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、分级运作周期届满，转型为东吴鼎利债券基金（LOF）后的收益分配原则：

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 8 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）场外的基金份额，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资人在不同

销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式，如投资人在某一销售机构交易账户不选择收益分配方式，则按默认的收益分配方式处理。场内的基金份额的分红方式为现金分红，投资人不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

（4）每一基金份额享有同等分配权；

（5）法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

（1）计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

（2）重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（a）对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

（b）对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自成立日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

（c）在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技

术确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起营改增后，基金买卖股票、债券的差价收入免收增值税。

2、对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、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对

价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

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
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海新东吴优胜资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.8 本报告期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期回购债券 成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	1,762,864,224.08	86.64%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日	
	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	18,429,977,000.00	78.41%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	3,717,996.98
其中：支付销售机构的客户维护费	884,805.65

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 $\times$ 0.7% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	1,062,284.84

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 $\times$ 0.20% / 当年天数

7.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日
	当期应支付的销售服务费
东吴证券股份有限公司	41,616.46
交通银行股份有限公司	33,282.87
东吴基金管理有限公司	815,876.43
合计	890,775.76

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 $\times$ 0.35% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 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
	2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	56,274,780.35
期间申购/买入总份额	—
期间因拆分增加的份额	—
期间赎回/卖出总份额	56,274,780.35
期末持有的基金份额	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00%

注：报告周期为 2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.8.4.2 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无投资本基金的情况。

7.4.8.5 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	
	2016 年 4 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
活期存款利息收入	3,636,962.96	97,559.52

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 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证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告(转型前)**8.1 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	507,419,277.67	88.77
	其中：债券	507,419,277.67	88.77
	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	20,000,000.00	3.50
	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	30,677,437.02	5.37
7	其他资产	13,511,810.52	2.36
8	合计	571,608,525.21	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合**8.2.1 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。

8.2.2 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。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

本基金本报告期间未持有股票。

8.4.2 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

本基金本报告期间未持有股票。

8.4.3 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。

8.5 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	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	中期票据	20,146,000.00	3.75
7	可转债（可交换债）	1,811,188.00	0.34
8	同业存单	—	—
9	其他	20,033,315.07	3.73
10	合计	507,419,277.67	94.44

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

8.6 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	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

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.10.2 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。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 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 投资组合报告(转型后)

8.1 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	702,302,149.55	94.77
	其中：债券	702,302,149.55	94.77
	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	—	—
	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	21,299,135.44	2.87
7	其他资产	17,439,422.87	2.35
8	合计	741,040,707.86	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.2.2 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。

8.3 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(转型后)

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

8.4.3 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。

8.5 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	92,175,394.00	16.66
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	559,168,755.55	101.07
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	50,958,000.00	9.21
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	702,302,149.55	126.94

8.6 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	112466	16 彩塑 01	500,000	49,020,000.00	8.86
2	112392	16 掌趣 01	430,780	43,689,707.60	7.90
3	019529	16 国债 01	415,000	41,500,000.00	7.50
4	019539	16 国债 11	414,280	41,374,143.60	7.48
5	112035	11 国脉债	395,589	40,793,137.68	7.37

8.7 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	60,608.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,815,665.75
5	应收申购款	563,148.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,439,422.87

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份 额 级 别	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
鼎 利 优 先	220	31,093.20	345,134.35	5.05%	6,495,370.45	94.95%
鼎 利 进 取	290	1,566,954.21	413,984,860.00	91.10%	40,431,860.09	8.90%
合 计	510	845,602.40	414,329,994.35	96.07%	16,927,230.54	3.93%

注：1. 个人投资者持有基金份额占总份额比例计算中，针对 A、B 类分级基金，比例的分母采用 A、B 类各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用 A、B 类分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2. 2016 年 4 月 25 日，转换日日终，东吴鼎利优先机构投资者及个人投资者持有的全部份额按照其分级基金份额净值转换成东吴鼎利（LOF）份额共计 6,841,900.95 份；东吴鼎利进取机构投资者及个人投资者持有的全部份额按照其分级基金份额净值转换成东吴鼎利（LOF）份额共计 530,444,305.38 份。

9.2 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	中国平安人寿保险股份有限公司	100,054,000.00	23.57%
2	东吴基金管理有限公司	45,026,325.00	10.61%
3	中国太平洋保险（集团）股份有限公司	40,021,600.00	9.43%
4	中国太平洋财产保险股份有限公司	40,021,600.00	9.43%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司-保额分红账户	40,021,600.00	9.43%
6	中能集团财务有限公司	25,014,625.00	5.89%
7	信泰人寿保险股份有限公司	20,023,400.00	4.72%
8	太平人寿保险有限公司	20,019,800.00	4.72%
9	东吴期货有限公司	20,019,800.00	4.72%
10	上海电气集团财务有限责任公司	20,011,700.00	4.72%

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

9.4 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 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
6,838	79,101.71	272,071,427.30	50.30%	268,826,042.49	49.70%

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。

9.2 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	21.27%
2	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	4,243,725.00	18.05%
3	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	11.91%
4	何能玉	610,725.00	2.60%
5	中国国际贸易中心有限公司企业年金计划—中国建设银行	439,936.00	1.87%
6	庄卫东	418,000.00	1.78%
7	叶漫红	400,000.00	1.70%
8	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	1.67%
9	周志刚	379,000.00	1.61%
10	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	1.28%

注：持有人为场内持有人。

9.3 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持有本基金	7,977.07	0.00%

9.4 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

§10 开放式基金份额变动**10.1 开放式基金份额变动（转型后）**

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
报告期期初基金份额总额	537,286,206.33
基金合转型效日起至报告期期末基金总申购份额	1,438,910,386.95
减:基金转型生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,435,299,123.49
基金转型生效日起至报告期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	540,897,469.79

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。

10.2 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
基金合同生效日（2013 年 4 月 25 日）基金份额总额	696,249,879.84	424,416,720.09
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 1 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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

本报告期内基金管理人发生以下人事变动：

- 1、2016 年 1 月 13 日，任少华先生不再担任公司董事一职，由范力、冯玉泉担任公司第二届董事会董事；
- 2、2016 年 1 月 16 日，吴永敏先生因退休不再担任公司董事长，由范力先生担任公司董事长。
- 3、2016 年 1 月 16 日，任少华先生因工作调动辞去公司总经理职务，由王炯先生担任公司总经理，同时王炯先生辞去其所担任的公司副总经理职务。
- 4、2016 年 5 月 4 日，吕晖先生担任公司副总经理。
- 5、2016 年 12 月 28 日，全卓伟女士不再担任公司董事一职，由倪雪梅女士担任公司第二届董事会董事。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 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涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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天衡会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金成立起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费 70000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）**11.7.1 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	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	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

本基金本报告期退租 1 个交易单元：华创证券。新增 3 个交易单元：广发证券 1 个、招商证券 2 个。

11.7.2 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	1,762,864,224.08	86.64%	18,429,977,000.00	78.41%	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	271,798,098.69	13.36%	5,073,200,000.00	21.59%	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 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	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	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、本基金本报告期交易单元无变化。

11.7.2 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	135,336,260.48	42.34%	260,000.00	0.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

华鑫证券	184,288,144.62	54.66%	8,763,000,000.00	100.00%	-	-
------	----------------	--------	------------------	---------	---	---

东吴基金管理有限公司

2017 年 3 月 27 日