

## 东吴鼎利分级债券型证券投资基金

## [2013] 第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

§ 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。

基金托管人和报告编制人根据本基金合同规定,于2013年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容,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。

本报告期未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

本报告期自2013年4月25日至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

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

契约型。

基金合同生效日起3年内,鼎利A每6个月开放一次,申购和赎回,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的基金资产将全部投资于同一分级运作周期后,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

报告期末基金份额总额 1,120,666,599.93份

投资目标 在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过对债券组合的合理安排,使债券品种的主动式管理,力争获得稳健的投资收益。

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,通过对于债券组合的期限、期限结构、债券品种的主动式管理,力争获得稳健的投资收益。

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

下属两级基金的基金简称 鼎利优先 鼎利进取

下属两级基金的交易代码 165808 150120

报告期末下属两级基金的份额总额 696,249,879.84份

报告期末下一报告期预期收益率 424,416,720.09份

利和A将表现出低风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。

下属两级基金的风险收益特征

利和B将表现出高风险、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。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月25日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 5,281,205.67

2.本期利润 6,351,847.10

3.加权平均基金份额本期利润 0.0058

4.期末基金份额净值 1,127,218,447.03

5.期末基金份额净值 1.006

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,本期利息收入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据。

3.本基金于2013年4月25日成立,报告期末未满一年。

3.2.1 本期报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 本期报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金净值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.本基金于2013年4月25日成立,基金合同生效日起至披露时点不满一年。按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起16个月内为建仓期。

3.其他指标

单位:人民币元

其他指标 报告期(2013年4月25日-2013年6月30日)

1.64048645:1

3.期末优先级份额参考净值 1.008

3.期末利优先份额累计参考净值 1.008

3.期末利优先份额累计参考净值 1.003

3.期末利优先份额累计参考净值 1.003

利优先的前十收益率 4.15%

注:利优先约定收益率=一年期银行定期存款利率+0.76个基点Shibor×0.5。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 在本基金的基金经理 期限 说明

丁惠 本基金固定收益部 总经理 2013年4月25日 - 13.5年 上市管理硕士,历任中信证券上海营业部交易员,汉唐证券固定收益部债券投资主管,航天科工资产管理公司投资总监;2011年7月加入东吴基金管理有限公司,历任东吴基金管理有限公司高级经理,东吴基金管理有限公司高级经理,东吴债利分级债券型证券投资基金基金经理,东吴保本混合基金基金经理,东吴债利和分级债型证券投资基金基金经理。

杨庆定 本基金固定收益部副总 经理 2013年6月25日 - 6年 管理学博士,历任大成国际资信评估有限公司债券部总经理,大成基金管理有限公司高级经理,东吴基金管理有限公司高级经理,东吴债利分级债券型证券投资基金基金经理。

注:1.丁惠为该基金的首任基金经理,此处的任职日期为基金成立日,其他日期指公司对外公告

2.如果本报告期发生更换基金经理,则在原任基金经理的任职日期后将包含该业务份额。

3.其他指标

单位:人民币元

其他指标 报告期(2013年4月25日-2013年6月30日)

1.64048645:1

3.期末利优先份额参考净值 1.008

3.期末利优先份额累计参考净值 1.008

3.期末利优先份额累计参考净值 1.003

3.期末利优先份额累计参考净值 1.003

利优先的前十收益率 4.15%

注:利优先约定收益率=一年期银行定期存款利率+0.76个基点Shibor×0.5。

§ 5 管理人报告

4.1.1 本报告期内本基金的基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.2 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.3 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.4 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.5 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.6 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.7 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.8 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.9 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.10 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.11 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.12 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.13 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.14 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.15 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.16 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.17 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.18 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.19 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.20 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.21 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.22 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.23 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.24 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.25 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.26 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.27 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.28 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.29 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.30 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.31 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.32 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.33 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.34 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.35 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.36 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.37 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.38 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.39 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.40 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.41 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.42 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.43 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.44 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.45 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.46 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.47 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.48 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.49 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.50 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.51 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.52 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.53 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.54 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.55 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.56 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.57 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.58 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.59 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.60 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.61 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.62 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.63 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.64 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.65 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.66 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.67 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.68 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.69 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.70 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.71 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.72 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.73 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明

4.1.74 本报告期内,本基金基金经理发生变更,新任基金经理的姓名、任职日期、说明