

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:二〇一五年八月二十七日

## § 1 重要提示及目录

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,并对基金的内部真实性、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确认,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定,于2015年8月24日核对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摘要。

本半年度报告摘要自半年度报告发布之日起,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2015年01月01日起至2015年06月30日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	东吴鼎利分级债券型证券投资基金	
场内简称	东吴鼎利	
基金代码	165807	
交易代码	165807	
基金上市方式	上市契约型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2013年6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	
报告期末基金资产总额	654,564,025.36	
基金份额净值	1.0980	
基金合同存续的起止日期	不定期	
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2013-06-25	
下属分级基金的基金简称	鼎利优享	鼎利进取
下属分级基金的交易代码	165808	165809
报告期末下属分级基金的份额总额	230,137,306.07份	424,416,720.09份

## 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,力争提供稳定的收益。
投资策略	本基金将根据宏观经济、利率走势、信用利差、流动性、资金面、政策面、基本面等多方面因素,综合分析判断,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,力争提供稳定的收益。
业绩比较基准	中国债券总指数的收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预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。
风险等级	低风险
风险收益特征	鼎利优享
风险收益特征	鼎利进取
下属分级基金的风险特征	鼎利优享将根据出现风险、低收益的可能,鼎利进取则表现出高风险、高收益的显著特征,预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金。
收益特征	本基金为债券型基金,其预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	徐军	高峰
联系电话	021-56098899-8308	96569
电子邮箱	xiujun@eastmoney.com	tangy@bankocomm.com
客户服务电话	021-56099666/400-821-0688	96569
传真	021-56098899-8211	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.eastfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人办公处

## § 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

报告期金额(元)		报告期(2015年1月1日-2015年6月30日)	
本期实现收益		36,440,961.34	
本期利润		46,779,020.87	
加权平均基金份额本期利润		0.0676	
本期利润的所得税费用		7.13%	
报告期利润		报告期(2015年6月30日)	
可供分配利润		0.0364	
期末可供分配基金份额总额		718,172,996.54	
期末基金资产净值		1.097	

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.期末可供分配金额为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、赎回费用等,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

4.基金成立于2013年6月25日。

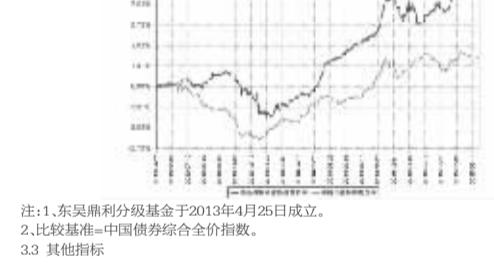
## 3.2 基金净值表现

## 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	份额增长率为 单日 (%)	份额增长率为 标准差 (%)	业绩比较基准 收益率 (%)	①-③	②-④
过去一个月	1.48%	0.06%	-0.08%	0.09%	1.56%
过去3个月	6.51%	0.18%	1.35%	0.10%	5.16%
过去6个月	7.13%	0.23%	1.20%	0.10%	5.93%
过去1年	11.64%	0.19%	3.60%	0.11%	8.04%
自基金合同生效至今	14.20%	0.18%	2.71%	0.10%	11.58%

注:比较基准为: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.东吴鼎利分级基金于2013年6月25日成立。

2.比较基准=中国债券综合全价指数。

## 3.3 其他指标

单位:人民币元

报告期末		报告期(2015年6月30日)	
本期末		36,440,961.34	
本期利润		46,779,020.87	
加权平均基金份额本期利润		0.0676	
本期利润的所得税费用		7.13%	

注:东吴鼎利分级基金于2013年6月25日成立。

2.比较基准=中国债券综合全价指数。

## 3.4 其他指标

单位:人民币元

报告期末		报告期(2015年6月30日)	
本期末		10,008	
本期利润		1,096	
可供分配利润		1,140	
期末可供分配基金份额总额		1,140	

注:东吴鼎利分级基金于2013年6月25日成立。

2.比较基准=中国债券综合全价指数。

## 3.5 其他指标

单位:人民币元

报告期末		报告期(2015年6月30日)	
本期末		10,008	
本期利润		1,096	
可供分配利润		1,140	
期末可供分配基金份额总额		1,140	

注:东吴鼎利分级基金于2013年6月25日成立。

2.比较基准=中国债券综合全价指数。

## 3.6 其他指标

单位:人民币元

报告期末		报告期(2015年6月30日)	



<tbl\_r cells="2" ix="3" maxcspan="2" maxrspan