

东吴鼎利分级债券型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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:二〇一四年一月二十二日

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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。

基金托管人及代销机构对本报告所载资料不存在虚假记载、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。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

5.2 基金产品概况

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

契约型

基金合同生效日起3年内，鼎利A和鼎利B的基金资产合并运作。

基金运作方式 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。

基金合同生效日 2013年9月25日

报告期末基金份额总额 769,151,111.87份

投资目标 在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过对债券组合合理期限、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，通过对债券组合合理期限、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。

5.3 业绩比较基准 中国债券组合全价指数。

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

下属两级基金的基金简称 鼎利优先

下属两级基金的交易代码 151020

报告期末下属两级基金的份额总额 344,734,391.78份

报告期末下属两级基金的份额总额 424,416,720.09份

下属两级基金的风险收益特征 鼎利A将更侧重于高风险、高收益的明显特征，其预期收益率和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

下属两级基金的基金简称 鼎利进取

下属两级基金的交易代码 151020

报告期末下属两级基金的份额总额 6,913,469.57

报告期末下属两级基金的份额总额 -20,930,374.99

报告期末平均基金份额本期利润 0.0246

5.4 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 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 行业票据 - -

3 金融债券 66,886,000.00 8.96

其中:政策性金融债 66,886,000.00 8.96

4 企业债券 1,028,405,050.94 137.83

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 - -

7 可转债 4,741,043.00 0.64

8 其他 40,720,047.53 5.46

9 合计 1,140,752,141.47 152.88

注:在持仓中中小企业私募债情况

代销机构:东吴基金管理有限公司

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 122634 12尧光01 500,000 51,550,000.00 6.91

2 122626 12海恒债 500,000 51,250,000.00 6.87

3 126200 12鑫泰债 500,000 50,745,000.00 6.80

4 124264 13晋城投 500,000 50,389,225.62 6.75

5 126285 12吉城投 500,000 50,000,000.00 6.70

注: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

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 122634 12尧光01 500,000 51,550,000.00 6.91

2 122626 12海恒债 500,000 51,250,000.00 6.87

3 126200 12鑫泰债 500,000 50,745,000.00 6.80

4 124264 13晋城投 500,000 50,389,225.62 6.75

5 126285 12吉城投 500,000 50,000,000.00 6.70

注: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

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权证投资明细

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

5.9 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

5.10 本期未持有权证。

5.11 本期未持有权证。

5.12 本期未持有权证。

5.13 本期未持有权证。

5.14 本期未持有权证。

5.15 本期未持有权证。

5.16 本期未持有权证。

5.17 本期未持有权证。

5.18 本期未持有权证。

5.19 本期未持有权证。

5.20 本期未持有权证。

5.21 本期未持有权证。

5.22 本期未持有权证。

5.23 本期未持有权证。

5.24 本期未持有权证。

5.25 本期未持有权证。

5.26 本期未持有权证。

5.27 本期未持有权证。

5.28 本期未持有权证。

5.29 本期未持有权证。

5.30 本期未持有权证。

5.31 本期未持有权证。

5.32 本期未持有权证。

5.33 本期未持有权证。

5.34 本期未持有权证。

5.35 本期未持有权证。

5.36 本期未持有权证。

5.37 本期未持有权证。

5.38 本期未持有权证。

5.39 本期未持有权证。

5.40 本期未持有权证。

5.41 本期未持有权证。

5.42 本期未持有权证。

5.43 本期未持有权证。

5.44 本期未持有权证。

5.45 本期未持有权证。

5.46 本期未持有权证。

5.47 本期未持有权证。

5.48 本期未持有权证。

5.49 本期未持有权证。

5.50 本期未持有权证。

5.51 本期未持有权证。

5.52 本期未持有权证。

5.53 本期未持有权证。

5.54 本期未持有权证。

5.55 本期未持有权证。

5.56 本期未持有权证。

5.57 本期未持有权证。

5.58 本期未持有权证。

5.59 本期未持有权证。

5.60 本期未持有权证。

5.61 本期未持有权证。

5.62 本期未持有权证。

5.63 本期未持有权证。

5.64 本期未持有权证。

5.65 本期未持有权证。

5.66 本期未持有权证。

5.67 本期未持有权证。

5.68 本期未持有权证。

5.69 本期未持有权证。

5.70 本期未持有权证。

5.71 本期未持有权证。

5.72 本期未持有权证。

5.73 本期未持有权证。

5.74 本期未持有权证。

5.75 本期未持有权证。

5.76 本期未持有权证。

5.77 本期未持有权证。

5.78 本期未持有权证。

5.79 本期未持有权证。

5.80 本期未持有权证。

5.81 本期未持有权证。

5.82 本期未持有权证。

5.83 本期未持有权证。

5.84 本期未持有权证。

5.85 本期未持有权证。

5.86 本期未持有权证。

5.87 本期未持有权证。

5.88 本期未持有权证。

5.89 本期未持有权证。

5.90 本期未持有权证。

5.91 本期未持有权证。

5.92 本期未持有权证。

5.93 本期未持有权证。

5.94 本期未持有权证。

5.95 本期未持有权证。

5.96 本期未持有权证。

5.97 本期未持有权证。

5.98 本期未持有权证。

5.99 本期未持有权证。

5.10 本期未持有权证。

5.11 本期未持有权证。

5.12 本期未持有权证。

5.13 本期未持有权证。

5.14 本期未持有权证。

5.15 本期未持有权证。

5.16 本期未持有权证。

5.17 本期未持有权证。

5.18 本期未持有权证。

5.19 本期未持有权证。

5.20 本期未持有权证。

5.21 本期未持有权证。

5.22 本期未持有权证。

5.23 本期未持有权证。

5.24 本期未持有权证。

5.25 本期未持有权证。

5.26 本期未持有权证。

5.27 本期未持有权证。