

东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）

2017 年年度报告 摘要

2017 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：二〇一八年三月三十一日

§ 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 2018 年 3 月 27 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。

本报告期自 2017 年 01 月 01 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

基金简称	东吴鼎利（LOF）
场内简称	东吴鼎利
基金主代码	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	61,167,856.01 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

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

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	2017 年	2016 年 4 月 26 日(基	2015 年
---------------	--------	-------------------	--------

		金转型生效 日)-2016 年 12 月 31 日	
本期已实现收益	-519,636.59	24,087,275.81	-
本期利润	7,411,459.16	12,476,734.14	-
加权平均基金份额本期利润	0.0297	0.0165	-
本期基金份额净值增长率	3.13%	2.30%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2875	0.2965	-
期末基金资产净值	64,509,860.33	553,271,847.10	-
期末基金份额净值	1.055	1.023	-

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

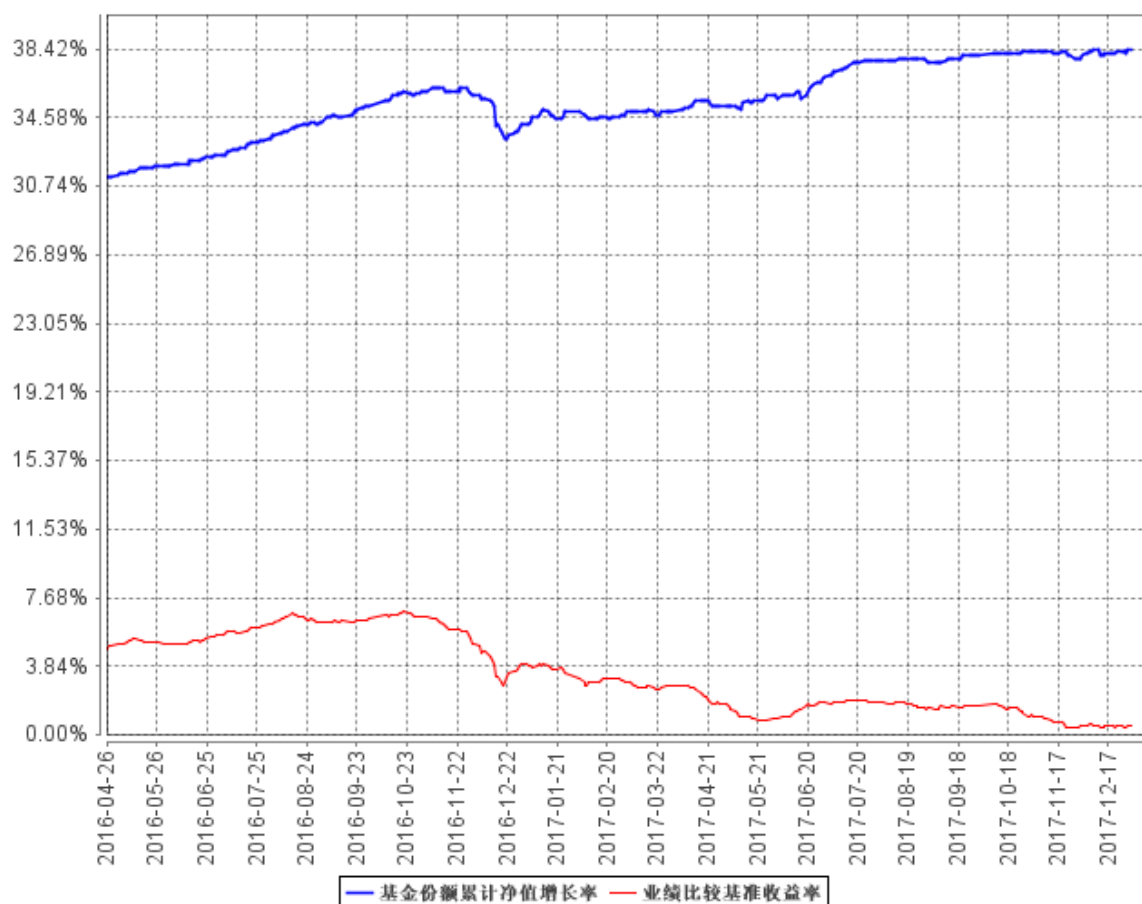
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率	份额净值 增长率标 准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去三个月	0.29%	0.07%	-1.15%	0.06%	1.44%	0.01%
过去六个月	1.15%	0.05%	-1.30%	0.05%	2.45%	0.00%
过去一年	3.13%	0.07%	-3.38%	0.06%	6.51%	0.01%
自基金转型 生效起至今	5.50%	0.08%	-4.09%	0.08%	9.59%	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



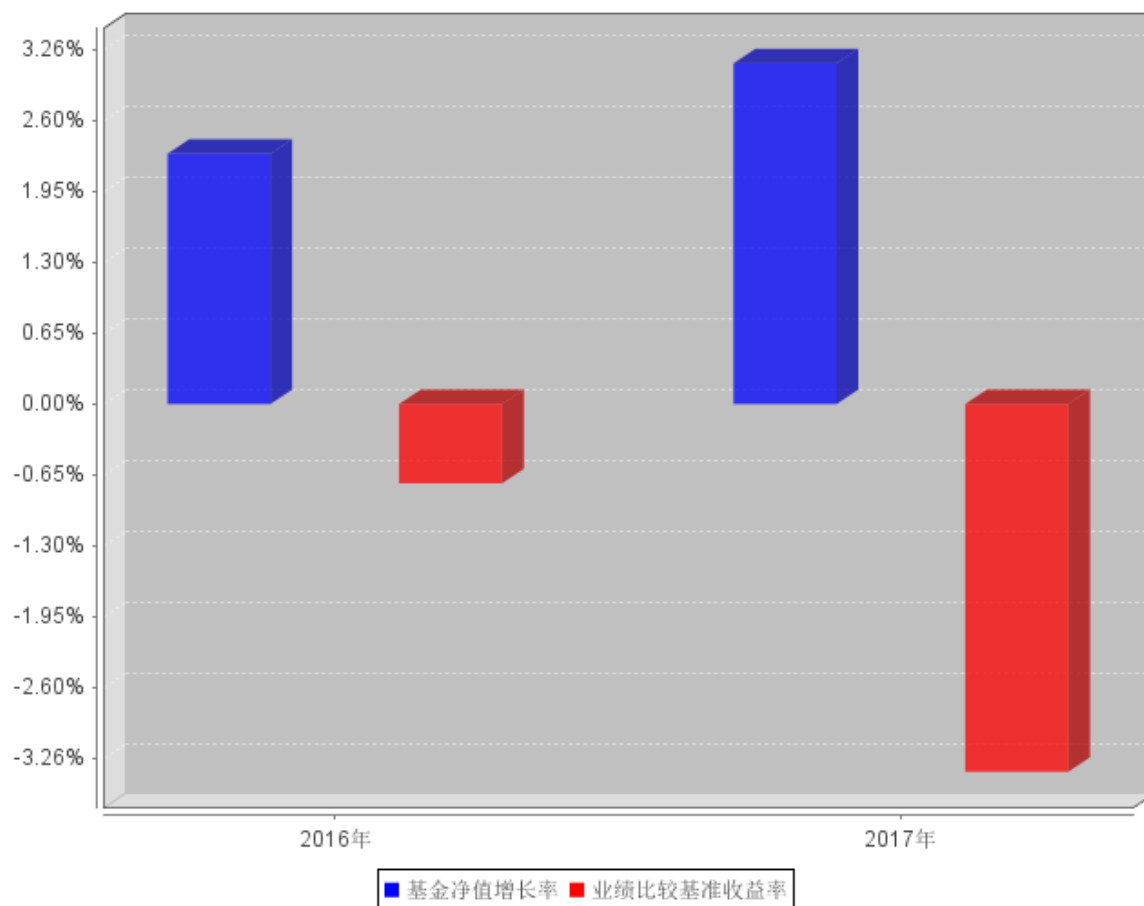
注：1、比较基准=中国债券综合全价指数。

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 2017 年 12 月 31 日。

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：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

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 日获证监基金字[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海澜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、特定客户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、共享共赢”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“战略性人才梯队建设、市场化体制机制改革”的经营策略指导下,公司各项业务快速发展,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 2017 年 12 月 31 日,公司管理的资产规模合计 752.89 亿元,其中,公募基金管理规模 266.41 亿元,专户资产管理规模 256.09 亿元,子公司专项资产管理规模 230.39 亿元;管理各类产品 156 只,其中,公募基金 27 只,专户产品 60 只,子公司资产计划 69 只,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。2017 年公司绝对收益策略基金,通过灵活调整,在上半年市场震荡中,规避了市场大幅回调的风险,业绩排名持续位列同类基金前列。2017 年,公司的固定收益投资能力跃居行业“第一梯队”。据海通证券固定收益类资产业绩排行榜显示,截至 2017 年年底,公司旗下的固定收益类基金以 8.29%的净值增长率,位列最近两年 83 家入选基金公司的第二位。

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

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	2013 年 6 月	-	12 年	杨庆定,博士,上海交

	总监、固定收益总部总经理、本基金基金经理	25 日			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总监、固定收益总部总经理，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 日任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金（原东吴配置优化混合型证券投资基金），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	-	6 年	陈晨，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，自 2017 年 11 月 28 日起担任东吴优益债券型证券投资基金。
--	--	--	--	--	---

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，本基金因持有的个别债券连续停牌，出现连续十个交易日以上持有一家公司发行的证券市值超过基金资产净值 10%的情形。除此之外，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

2017 年初，市场普遍预期实体融资需求不强、经济增长动能较弱，而实际上 2017 年 GDP 增速达到 6.9%，实现 2010 年以来 GDP 增速的首次回升。随着外部需求明显好转，人民币有效汇率下降，以及 PPI 对出口价格的向上带动，出口成为 2017 年经济增长超预期最重要的因素。地产投资方面，2017 年房地产投资增速录得 7.0%，商品房销售面积增速 7.7%，销售回落幅度平稳；土地购置面积与土地成交价款增速持续回升，使得虽然房地产投资处于下行的大周期，但土地购置较为旺盛在一定程度上形成支撑，房地产投资增速回落的速度与幅度低于市场预期。通胀方面，2017 年 CPI 各月同比基本位于 1.0%-2.0%区间，PPI 同比高位逐步回落。

2017 年金融监管政策贯穿全年，3 月末 MPA 考核对银行体系流动性构成较大压力并传导至非银机构，2 季度以来金融系统相关监管与服务机构均出台相关政策措施，金融监管思路逐渐清晰，金融工作会议及十九大中均强调金融监管的协调，金稳会也在 11 月成立。货币政策方面，2016 年底中央经济工作会议确定货币政策中性稳健基调，2017 年整体维持偏紧，春节前后数次上调各项流动性投放工具操作利率，12 月末美联储加息后公开市场操作利率也顺势上调。

债券市场表现来看，在经济韧性较强及监管加码的环境下，上半年债市收益率整体上行，10 年期国债收益率由去年底 3.0%上行至 3.6%-3.7%区间，6 月随着市场对监管预期的改善以及资金面的好转，收益率有所下行，但 3 季度末至 4 季度初债市收益率再度大幅上行。全年来看，10 年期国债与国开债收益率分别上行约 90bp 和 115bp。

2017 年本基金基本保持中性杠杆和久期水平，实现了较好收益。

4.4.2 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 1.055 元，累计净值 1.351 元；本报告期份额净值增长率 3.13%，同期业绩比较基准收益率为-3.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年外需增长幅度大概率略低或持平于 2017 年，人民币实际有效汇率已开启回升将对出口构成抑制，同时 PPI 对出口价格的带动也会弱化，因此我们认为，2018 年出口仍是经济增长的积极因素，但拉动作用将低于 2017 年。房地产市场的低库存状态，以及政策继续收紧概率较低，使得房地产投资增速回落幅度较为可控；基建投资将继续发挥“托底”作用，当前政策思路强调的是高质量的经济增长和化解系统性金融风险，因此 2018 年基建投资增速不会有明显提升；2017 年工业企业基本面持续改善，资产负债率下降、盈利能力上升，制造业投资增速也基本完成筑底，2018 年可能会是一个继续缓慢回升的状态。因此我们认为 2018 年中国经济还是会呈现较强的韧性，由于出口、地产和基建都存在边际回落的因素，因此 2018 年经济增速也会有温和的回落，GDP 增速大概率会落在 6.5%—7.0%区间的偏下限水平。

对债市整体判断方面，本轮及 2013 年债券熊市的根本原因在于较强的经济基本面，事实上去年及 2013 年基本面表现是超出市场上大多数人预期的，因此对于债券市场方向的判断，最终还是要落实到对经济基本面的判断。根据我们对 2018 年经济增长的判断，我们认为 2018 年利率较难再出现趋势性的上行。但非基本面的因素对利率变化的幅度和持续时间影响较大，2017 年监管思路逐步清晰、措施逐步明确，2018 年监管将继续推进实施，监管对市场的影响也将继续发酵，利率高位大概率有所持续。

操作策略方面，我们将保持对市场研究与跟踪，并灵活调整组合杠杆和久期。

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）紧跟流动性要求，完善风险控制手段。本基金管理人根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》要求持续关注流动性新规执行情况，从制度建设、系统控制、指标监测、部门间协作等方面，不断优化流动性管理工作流程，建立健全本基金管理人流动性风险管理内部控制体系。

（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）跟踪监管动态，及时落实新规。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规及监管要求进行内部讨论，成立工作小组，制订落实方案。及时开展内部培训，修改相关制度与流程，升级业务系统并设置风控阈值，保障基金投资符合监管要求。

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，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

本基金本报告期末进行利润分配。

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

2017 年，基金托管人在东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2017 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）（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

2017 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）的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

本报告期基金财务报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了安永华明（2018）审字第 60469066_B15 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

7.1 资产负债表

会计主体：东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末	上年度末
-----	-----	------

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	187,186.40	3,636,962.96
结算备付金	2,657,979.38	17,662,172.48
存出保证金	6,388.23	60,608.36
交易性金融资产	77,489,944.80	702,302,149.55
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	77,489,944.80	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	1,377,225.39	-
应收利息	2,979,381.31	16,815,665.75
应收股利	-	-
应收申购款	66,929.00	563,148.76
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	84,765,034.51	741,040,707.86
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 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	19,500,000.00	180,830,000.00
应付证券清算款	212,998.97	2,625,605.11
应付赎回款	410,991.49	3,177,034.03
应付管理人报酬	49,193.29	482,179.36
应付托管费	14,055.24	137,765.53
应付销售服务费	24,596.68	241,089.68
应付交易费用	175.00	2,825.00
应交税费	724.06	724.06
应付利息	-7,638.14	10,985.75
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	50,077.59	260,652.24
负债合计	20,255,174.18	187,768,860.76
所有者权益：		
实收基金	44,428,397.20	392,892,807.32
未分配利润	20,081,463.13	160,379,039.78
所有者权益合计	64,509,860.33	553,271,847.10

负债和所有者权益总计	84,765,034.51	741,040,707.86
------------	---------------	----------------

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.055 元，基金份额总额 61,167,856.01 份。

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日(基金转 型生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	12,491,352.51	21,946,576.90
1. 利息收入	17,343,649.61	32,623,077.85
其中：存款利息收入	94,947.42	262,479.38
债券利息收入	17,170,675.11	32,289,454.26
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	78,027.08	71,144.21
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-12,814,509.52	740,252.43
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-12,814,509.52	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）	7,931,095.75	-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）	31,116.67	193,788.29
减：二、费用	5,079,893.35	9,469,842.76
1. 管理人报酬	1,848,775.65	3,717,996.98
2. 托管费	528,221.58	1,062,284.84
3. 销售服务费	924,387.91	1,858,998.50
4. 交易费用	9,164.36	28,783.12
5. 利息支出	1,429,598.11	2,562,281.56
其中：卖出回购金融资产支出	1,429,598.11	2,562,281.56
6. 其他费用	339,745.74	239,497.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	7,411,459.16	12,476,734.14
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	7,411,459.16	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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	392,892,807.32	160,379,039.78	553,271,847.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,411,459.16	7,411,459.16
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）	-348,464,410.12	-147,709,035.81	-496,173,445.93
其中：1. 基金申购款	148,008,877.47	61,916,023.16	209,924,900.63
2. 基金赎回款	-496,473,287.59	-209,625,058.97	-706,098,346.56
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）	44,428,397.20	20,081,463.13	64,509,860.33
项目	上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日(基金转型生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金转型生效日所有者权益（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	-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	_____ 吴婷
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

东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2012]1609号《关于同意东吴鼎利分级债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司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。本基金分级运作周期届满后，转型为上市开放式基金（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，注册登记机构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，本基金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），基金名称变更为“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）”。转换为东吴鼎利（LOF）后，本基金鼎利B份额将不再上市交易。基金管理人东吴基金管理有限公司已向深圳证券交易所申请终止本基金鼎利B份额的上市交易，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》深证上[2016]207号的同意。

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）。本基金不能参与一级市场新股申购，也不能在二级市场上投资股票、权证等权益类资产。

业绩比较基准为中国债券综合全价指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指

导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，按照取得时的公允价值

作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或收取该金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(2) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(3) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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，且该种法定权利现在是可执行的，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所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6)资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(8)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(9)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(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)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资

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)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的

股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日 (基金转型生效日) 至 2016 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	822,414,237.80	100.00%	1,762,864,224.08	86.64%

7.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日 (基金转型生效日) 至 2016 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

	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	5,758,657,000.00	100.00%	18,429,977,000.00	78.41%

7.4.7.1.4 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。

7.4.7.1.5 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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日(基金转型生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	1,848,775.65	3,717,996.98
其中：支付销售机构的客 户维护费	463,670.59	884,805.65

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日(基金转型生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	528,221.58	1,062,284.84

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
东吴证券股份有限公司	2,681.99
交通银行股份有限公司	22,346.13
东吴基金管理有限公司	388,663.56
合计	413,691.68
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日(基金转型生效日)至 2016 年 12 月 31 日
	当期发生的基金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：基金销售服务费用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。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日(基金转型生效日)至 2016 年 12 月 31 日
基金转型生效日（2016 年 4 月 26 日）持有的基金份额	-	56,274,780.35
期初持有的基金份额	-	56,274,780.35
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：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	-	0.0000%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.7.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.7.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 4 月 26 日(基金转型生效日)至 2016 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
交通银行股份有限公司	187,186.40	21,523.39	3,636,962.96	97,559.52

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017 年度获得的利息收入为人民币 69,054.67 元(2016 年度：人民币 149,385.93 元)，2017 年末结算备付金余额为人民币 2,657,979.38 元(2016 年末：人民币 17,662,172.48 元)。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.7.7 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。

7.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.9 期末（2017 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/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 19,500,000.00 元,于 2018 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 77,489,944.80 元,无属于第一层次和第三层次余额(于 2016 年 12 月 31 日,属于第二层次的余额为人民币 702,302,149.55 元,无属于第一层次和第三层次余额)。

7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层

次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期末未发生变动。

7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上年度末均未以第三层次公允价值计量。

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的承诺事项。

7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	77,489,944.80	91.42
	其中：债券	77,489,944.80	91.42
	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	2,845,165.78	3.36
8	其他各项资产	4,429,923.93	5.23
9	合计	84,765,034.51	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港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

本基金本报告期间未持有股票。

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	4,755,400.50	7.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,090,980.00	6.34
	其中：政策性金融债	4,090,980.00	6.34
4	企业债券	68,643,564.30	106.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	77,489,944.80	120.12

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	136192	16 信威 01	405,170	39,771,487.20	61.65
2	112294	15 海伟 02	45,000	4,405,500.00	6.83
3	019563	17 国债 09	41,730	4,166,740.50	6.46
4	108601	国开 1703	41,000	4,090,980.00	6.34
5	122622	PR 锦城债	99,990	4,050,594.90	6.28

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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,388.23
2	应收证券清算款	1,377,225.39
3	应收股利	-
4	应收利息	2,979,381.31
5	应收申购款	66,929.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,429,923.93

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

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
2,160	28,318.45	4,281,367.79	7.00%	56,886,488.22	93.00%

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	中国太保集团股份有限公司 - 本级 - 集团自有资金 -012G-ZY001	2,800,497.00	49.64%
2	中国太平洋人寿保险股份有 限公司 - 传统 - 普通保险产品	500,000.00	8.86%
3	中国国际金融(香港)有限公 司 - 中金人民币固定收益基 金	290,000.00	5.14%
4	彭贺章	200,020.00	3.55%
5	太平人寿保险有限公司	194,596.00	3.45%
6	阙睿	163,854.00	2.90%
7	黄军荣	145,100.00	2.57%
8	陈小港	107,200.00	1.90%
9	张志军	100,000.00	1.77%
10	平安大华基金 - 平安银行 - 平安大华固定收益增强六号 特定客户资	100,000.00	1.77%

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

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。

§ 10 开放式基金份额变动

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
本报告期期初基金份额总额	540,897,469.79
本报告期基金总申购份额	203,746,501.29
减:本报告期基金总赎回份额	683,476,115.07
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	61,167,856.01

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。

§ 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、2017 年 4 月 10 日，冯玉泉不再担任公司董事一职，由陈建国担任公司董事会董事。
- 2、2017 年 12 月 27 日，陈辉峰、陈如奇、倪雪梅、贝政新不再担任公司董事一职，由汤勇、周虹、张婉苏、方志刚担任公司董事会董事。

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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2017 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费 50000 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

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	-	-	-	-	-
中金证券	2	-	-	-	-	-

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 2 个交易单元：华创证券 1 个、广发证券 1 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	822,414,237.84	100.00%	5,758,657,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-

东吴基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日