东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书更新摘要

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

【重要提示】

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。本基金的基金合同于2013年4月25日正式生效。根据基金合同有关规定,本基金基金合同生效后3年期届满即2016年4月25日,无需召开基金份额持有人大会,本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)"。基金管理人已于2016年4月25日办理完毕运作期届满转换相关工作,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)",基金简称变更为"东吴鼎利(LOF)",基金代码仍为165807,场内简称仍为"东吴鼎利"。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。其中,本基金投资范围包括中小企业私募债,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。相对而言,中小企业私募债券存在较高的流动性风险和信用风险。尽管本基金将中小企业私募债券的投资比例控制在一定的范围内,但仍然提请投资者关注中小企业私募债存在的上述风险及其对基金总体风险的影响。

本基金是债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,长期风险收益特征高于货币市场基金,低于股票基金、混合基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本基金投资范围包括中小企业私募债,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。相对而言,中小企业私募债券存在较高的流动性风险和信用风险。尽管本基金将中小企业私募债券的投资比例控制在一定的范围内,但仍然提请投资者关注中小企业私募债存在的上述风险及其对基金总体风险的影响。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2017年10月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日。(财务数据未经审计)

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
1. 名称:东吴基金管理有限公司
2. 住所:上海市浦东新区源深路279号 (200135)
3. 办公地址:上海市浦东新区源深路279号 (200135)
4. 法定代表人:王炯
5. 设立日期:2004年9月2日
6. 批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132号
7. 组织形式:有限责任公司(国内合资)
8. 注册资本:1亿元人民币
9. 联系人:贾云鹏
10.电话:(021)50509888
11.传真:(021)50509884
12.客户服务电话:400-821-0588(免长途话费)、021-50509666
13.公司网址:www.scfund.com.cn
14.股权结构:
(1)股权结构:

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	7000	70%
上海兰生(集团)有限公司	3000	30%
合计	10,000	100%

(2)简要情况介绍:

公司实行董事会领导下的总经理负责制,公司总经理下设投资决策、风险管理、产品开发、专户投资四个专门委员会;公司设有固定收益部、绝对收益部、权益投资部、深圳业务总部、上海投资一部、上海投资二部、专户业务事业部、研究策划部、集中交易室、机构业务部、渠道业务部、金融同业部、营销管理部、苏州分公司、产品策略部、基金事务部、信息技术部、财务管理部、综合管理部、合规风控部共20个部门。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

范力先生,董事长,硕士,高级经济师,中共党员。历任苏州团市委常委、办公室主任兼事业部部长,苏州证券公司投资部副经理、办公室主任、人事部总经理;东吴证券有限责任公司总裁助理、董事会秘书、经纪分公司总经理、公司副总裁、常务副总裁;东吴证券股份有限公司党委副书记、常务副总裁、副董事长。现任东吴证券股份有限公司党委书记、董事长、总裁。

陈辉峰先生,副董事长,大学学历,高级国际商务师,中共党员。历任上海轻工国际(集团)有限公司五金分公司总经理、上海轻工国际发展有限公司副总经理、上海兰生股份有限公司常务副总经理、总经理、上海兰生(集团)有限公司营运管理部总经理。现任上海东浩兰生国际服务贸易(集团)有限公司投资发展部总经理。

王炯先生,董事,硕士研究生、经济师,中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员,东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理,东吴基金管理有限公司常务副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯恂女士,董事,博士研究生,经济师,中共党员。历任东吴证券研究所研究员,国联证券研究所所长、总裁助理兼经管总部总经理、副总裁,东吴证券总规划师兼研究所所长,现任东吴证券股份有限公司副总裁、总规划师兼资产管理总部总经理。

陈建国先生,董事,硕士研究生,经济师,中共党员。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理,东吴证券昆山前进中路证券营业部副总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理、东吴证券经纪管理总部副总经理(主持工作),现任东吴证券人力资源部总经理。

倪雪梅女士,董事,大学本科,高级会计师,中共党员。历任浙江省嘉兴市审计局工交审计科科员,上海上工会计师事务所项目经理,上海万隆会计师事务所有限公司高级项目经理、合伙人,上海市国际展览有限公司财务部经理。现任上海东浩兰生国际贸易服务有限公司计财部副总经理。自2016年12月28日起在公司第二届董事会任职。

贝政新先生,独立董事,大学,教授,博士生导师。历任苏州大学商学院财经学院讲师、副教授。现任苏州大学商学院财经学院教授。

袁勇志先生,独立董事,教授,博士生导师。历任苏州大学管理学院教师、苏州大学人文社科处处长、苏州大学党委研究生工作部部长,现任苏州大学出版社副总编。

陈如奇先生,独立董事,大专学历,中共党员,高级经济师。历任新疆人民银行巴州中心支行科员,新疆农业银行巴州及自治区分行科长、处长,交通银行上海分行处长、副行长,交通银行广州分行行长,交通银行香港分行总经理等职。

2.监事会成员

顾锡康先生,监事会主席,硕士学位,高级工程师、经济师,中共党员。历任苏州电子计算机厂工程师、室主任,苏州人民银行科技科硬件组组长,苏州证券电脑中心经理、技术总监,东吴证券技术总监兼信息技术总部总经理,东吴证券股份有限公司合规总监、监事会主席。

王菁女士,监事,本科学士学位,会计师,中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理,现任东吴证券股份有限公司财务部总经理。

沈清韵,员工监事,硕士研究生,中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员,东吴基金管理有限公司监察稽核部副总经理,合规风控部总经理,现任东吴基金管理有限公司合规副总监兼合规风控部总经理。

3.高管人员

范力先生,董事长,硕士,高级经济师,中共党员。历任苏州团市委常委、办公室主任兼事业部部长,苏州证券公司投资部副经理、办公室主任、人事部总经理;东吴证券有限责任公司总裁助理、董事会秘书、经纪分公司总经理、公司副总裁、常务副总裁;东吴证券股份有限公司党委副书记、常务副总裁、副董事长。现任东吴证券股份有限公司党委书记、董事长、总裁。

王炯先生,总经理,硕士研究生、经济师,中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员,东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理,东吴基金管理有限公司常务副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

徐军女士,督察长,大学,会计师、审计师,中共党员。历任苏州市审计局财政、金融审计处科员、副处长,东吴证券财务部总经理,东吴基金管理有限公司财务负责人、公司总裁助理等职务,现任东吴基金管理有限公司督察长。

吕晖先生,副总经理,大专,历任苏州商业大厦业务员,苏州证券公司交易员,苏州证券登记公司总经理助理,东吴证券资产管理总部副总经理,东吴证券吴江盛泽西环路营业部、吴江中山北路营业部总经理,东吴基金管理有限公司总经理助理、运营总监等职,现任东吴基金管理有限公司副总经理。

4、基金经理

现任基金经理:

杨庆定,博士,上海交通大学管理学专业毕业。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,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。

历任基金经理:
丁蕙,2013年04月25日至2014年06月28日。

5、投资决策委员会成员
王炯公司总经理;
杨庆定固定收益部总经理;
刘元海 绝对收益部总经理;
戴斌权益投资部副总经理;
王立立 权益投资部副总经理兼研究策划部副总经理。
上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况
(一)基金托管人概况
公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:牛锡明
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:742.62亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:陆志俊
电话:95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2016年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本位列第13位,较上年上升4位;根据2016年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜,交通银行营业收入位列第153位,较上年上升37位。

截至2017年9月30日,交通银行资产总额为人民币89357.90亿元。2017年1-9月,交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币544.19亿元。交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称"托管中心")。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

牛锡明先生,董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长,2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生,副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事,2013年10月起任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长、广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系,获得学士学位,2005年于新疆财经学院获硕士学位。

(三)基金托管业务经营情况

截至2017年9月30日,交通银行共托管证券投资基金319只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定,加强内部管理,保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行,通过对各种风险的梳理、评估、监控,有效地实现对各项业务风险的管控,确保业务稳健运行,保护基金持有人的合法权益。

(二)内部控制原则

1、合法性原则:托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

2、全面性原则:托管中心建立各二级部门自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制,覆盖各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节,建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则:托管中心独立负责受托基金资产的保管,保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立,对不同的受托基金资产分别设置账户,独立核算,分账管理。

4、制衡性原则:托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则,从组织结构的设置上确保各二级部门和各岗位权责分明,相互牵制,并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则:托管中心在岗位、业务二级部门和风险合规部三级内控管理模式的基础上,形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制,通过行之有效的控制流程、控制措施,建立合理的内控程序,保障内控管理的有效执行。

6、效益性原则:托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应,尽量降低经营运作成本,以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

(三)内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国银行法》等法律法规,托管中心制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度,确保基金托管业务运行的规范、安全、高效,包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理暂行办法》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等,并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理,技术系统完整独立,业务管理制度化,核心作业区实行封闭管理,有关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理,聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人,根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人,发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为,应当及时通知基金管理人予以纠正,基金管理人收到通知后应及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的,交通银行须报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人,发现基金管理人有重大违规行为,须立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
1.直销机构:
(1)东吴基金管理有限公司直销中心
地址:上海市源深路279号
邮政编码:200135
电话:021-50509880
传真:021- 50509884
联系人:贾云鹏
客服电话:400-821-0588(免长途话费)、021-50509666
公司网址:www.scfund.com.cn
(2)网上交易
个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。
网上交易网址:www.scfund.com.cn
2、代销机构
(1)中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:蒋超良
联系人:刘峰
电话:(010)85108226
传真:(010)85109219
客服电话:95599
公司网址:www.abchina.com
(2)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
联系人:张静
传真:(010)66275654
客服电话:95533
公司网址:www.ccb.com
(3)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
联系人:张宏革
电话:021-58781234
传真:021-58408483
客服电话:95559
公司网址:www.bankcomm.com
(4)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
联系人:邓炯鹏
电话:(0755)83198888
传真:(0755) 83195049
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com
(5)中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:田国立
联系人:郭伟
电话:010-65557048
传真:010-65550827
客服电话:95558
公司网址:http://bank.ecitic.com
(6)平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:孙建一
联系人:张莉
电话:021-38637673
客服电话:40066-99999(免长途费)0755-961202
公司网址:www.pingan.com
(7)宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市江东区中山东路294号
办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号宁波银行大楼
法定代表人:陆华裕
联系人:胡技勋
电话:(0574)89068340
传真:(0574)87050024
客服电话:96528,上海地区962528
公司网址:www.nbcb.com.cn
(8)杭州银行股份有限公司
注册地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
办公地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人:吴太普
联系人:严峻
电话:0571-85108195
传真:0571-85106576
客服热线:0571-96523 400-8888-508
公司网址:www.hzbank.com.cn
(9)温州银行股份有限公司
注册地址:温州市车站大道华海广场1号楼
办公地址:温州市车站大道196号
法定代表人:邢增福
联系人:林波
电话:0577-88990082
传真:0577-88995217
客服电话:0577-96699
公司网址: www.wzbank.cn
(10)江苏银行股份有限公司
注册地址:南京市洪武北路55号
办公地址:南京市洪武北路55号
法定代表人:夏平
联系人:张洪玮
电话:025-58587036
传真:025-58587038
客服热线:96098,4008696098
公司网址:www.jsbchina.cn
(11)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 邮编:100032
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层邮编:100088
法定代表人:林义相
联系人:尹伶
联系电话:010-66045529
客服电话: 010-66045678
传真: 010-66045518
天相投顾网址: http://www.txsec.com
天相基金网网址:www.jjm.com.cn
(12)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:于杨
电话:021-20835779
传真:021-20835885
客服热线:400-920-0022
公司网址:http://licaike.hexun.com/
(13)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
联系人:方成
电话:021-38600735
传真:021-38509777
客服热线:400-821-5399
公司网址:www.noah-fund.com
(14)深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
联系人:张玉静
电话:0755-33227953
传真:0755-82080798
客服热线:4006-788-887
公司网址:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com
(15)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号26楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-54509953
客服热线:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn
(16)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-20613999
传真:021-68596916
客服热线:400-700-9665
公司网址:www.ehowbuy.com
(17)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张裕
电话:021-60897840
传真:0571-26698533
客服热线:4000 766 123
公司网址:www.fund123.cn
(18)上海长量基金销售投资顾问有限公司
代销机构:上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:敖玲
电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-820-2899
公司网站: www.erichfund.com
(19)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:杨翼
电话:0571-88911818转8565
传真:0571-86800423
客服热线:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
(20)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:李兴春
联系人:徐鹏
电话:86-021-50583533
传真:86-021-50583633
网址:http://a.leadfund.com.cn/
客户服务中心电话:400-921-7755
(21)浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室
办公地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室
法定代表人:徐黎云
联系人:来舒岚
电话:0571-88337888
传真:0571-88337666
客服热线:400-068-0058
公司网址:www.jincheng-fund.com
(22)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:戎兵
联系人:魏晨
电话:010-52413385
传真:010-85894285
客服热线:400-6099-200
公司网址:www.yixinfund.com
(23)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:周斌
联系人:祖杰
电话:010-57756159
传真:010-57756199
客服热线:4008980618
公司网址:www.chtfund.com
(24)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服热线:400-619-9059
公司网址:http://www.fundzone.cn
(25)北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区万通中心D座21&28层
法定代表人:蒋煜
联系人:宋志强
电话:131 2013 1908
传真:010-5817 0840
客服热线:400-818-8866
公司网址:www.gscaifu.com
(26)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
联系人:段京璐
电话:+86(10)88312877
传真:+86(10)88312885
客服热线:400-001-1566
公司网址:http://www.yilucaifu.com
(27)北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人:赵荣春
联系人:盛海娟
电话:15311484311
传真:010-57569671
客服热线:4008936885
公司网址:www.qianjing.com
(28)杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址:杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20F
法定代表人:陈刚
联系人:胡璇
电话:0571-85267500
传真:0571-85269200
客服热线:0571-86655920
公司网址:www.codi121.com
(29)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服热线:4000-466-788
公司网址:http://www.66zichan.com
(30)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:冯修敏
联系人:陈云卉
电话:021-33323999
传真:021-33323830
客服热线:4008202819
公司网址:http://www.chinapnr.com/
(31)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
联系人邮箱:NINGBOYU657@pingan.com.cn
客户服务电话: 4008219031
网址:www.lufunds.com
(32)大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人:袁顾明
联系人:朱真卿
电话:18616752315
传真:021-22268089
客服热线:021-22267943
公司网址:http://www.dtfortune.com/
(33)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室(邮编:510308)
法定代表人:肖雯
联系人:吴煜浩
电话:020-89629021
传真:020-89629011
联系人邮箱:wuyuhao@yingmi.cn
客户服务电话:020-89629066
网址:http://www.yingmi.cn/
(34)奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
客服热线:400-684-0500
公司网址:www.ifastps.com.cn
(35)中信期货有限公司
注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
联系人:韩钰
电话:010-60833754
传真:010-57762999
客户服务电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com
(36)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
联系人:芮敏祺
电话:021-38676161
传真:021-38670161
客户服务热线:95521
(37)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝内大街188号
法定代表人:张佑君
联系人:权唐
电话:(010)65183880
传真:(010)65182261
客服电话:400-8888-108
公司网址:www.csc108.com
(38)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6层
法定代表人:何如
联系人:周扬
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客服电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn
(39)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755)82943666
传真:(0755)82943636
联系人:林生迎
客服电话:95565、400-8888-111
公司网址:www.newone.com.cn
(40)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
电话:010-60833722
传真:010-60833739
客服热线:95558
公司网址:www.cs.ecitic.com
(41)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客服电话:021-95553
公司网址:www.htsec.com
(42)申万宏源证券有限公司
英文名称:Shenwan Hongyuan Securities Co., Ltd.
注册资本:人民币330亿元
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层(邮编:200031)
法定代表人:李梅
电话:021-33389888
传真:021-33388224
客服电话:95523或4008895523
电话委托:021-962505
国际互联网网址: www.swhysc.com
联系人:黄莹
(43)长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:杨泽柱
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
客服电话:95579或4008-888-999
公司网址:www.95579.com
(44)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02
办公地址:深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
联系人:陈剑虹
电话:0755-82825551
传真:0755-82558305
客服电话:400-800-1001
公司网址:www.essence.com.cn
(45)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:吴坚
联系人:张煜
电话:023-63786633
传真:023-63786212
客服热线:95355 、4008096096
公司网址:www.swsc.com.cn
(46)万联证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层
法定代表人:张建军
联系人:王鑫
电话:020-38286588
传真:020-38286588
客服热线:4008888133
公司网址:www.wlzq.com.cn
(47)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:杜庆平
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
客服电话:400-6515-988
公司网址:www.bhzq.com
(48)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼
法定代表人:周易
联系人:庞晓芸
电话:0755-82492193
传真:0755-82492962(深圳)
客服电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn
(49)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
联系人:吴忠超
客服电话: 95548
公司网址: www.citicssd.com
(50)东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
办公地址:苏州工业园区星阳街5号
法定代表人:范力
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
客服电话:0512-33396288
公司网址:www.dwzq.com.cn
(51)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
(52)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:刘晨、李芳芳
客服电话:4008888788、10108998
公司网址:www.ebscn.com
(53)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼
办公地址:广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼
法定代表人:邱三发
联系人:林洁茹
电话:020-88836999
传真:020-88836654
客服电话:020-961303
公司网址:www.gzs.com.cn
(54)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市四川中路213号久事商务大厦7楼
法定代表人:龚德雄
联系人:许曼华
联系电话:021-53686888
客户服务电话:021-962518
传真:021-53686100、021-53686200
网址:www.962518.com
(55)国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街8号6楼、7楼
办公地址:无锡市县前东街8号6楼、7楼
法定代表人:雷建辉
联系人:徐欣
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
客服电话:400 888 5288
公司网址:www.glsc.com.cn
(56)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层(518048)
法定代表人:谢永林
联系人:吴琼
电话:0755-22621866
传真:0755-82400862
客服热线:95511-8
公司网址:www.PINGAN.com
(57)华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人:李工
联系人:甘霖
电话:0551-65161821
传真:0551-65161672
客服电话:0551-96518或者4008096518
公司网址:www.hazq.com
(58)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅星路13号
办公地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅锋
联系人:牛孟宇
电话:0755-83709350
传真:0755-83704850
客服热线:95563
公司网址:www.ghzq.com.cn
(59)财富证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人:周晖
联系人:郭磊
电话:0731-84403319
传真:0731-84403439
客服电话:0731-84403350
公司网址: www.cfzq.com
(60)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:朱科敏
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn
(61)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区东风路111号
法定代表人:鞠瑾
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
联系人:常向东
客服电话:0471-4961259
公司网址:www.cnht.com.cn
(62)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号23层
办公地址:山东省济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
电话:(0531)68889155
传真:(0531)68889752
联系人:吴阳
客服电话:95538
公司网址:www.qlzq.com.cn
(63)中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
电话:0791-86768681
传真:0791-86770178
客服电话:400-8866-567
公司网址:www.avicsec.com
(64)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49层
法定代表人:张永衡
联系人:赖君伟
电话:0755-23902400
传真:0755-82545500
客服热线:40018-40028
公司网址:www.wkzq.com.cn
(65)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
法定代表人:俞洋
电话:021-64339000
注册资本:16亿元人民币
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
邮政编码:200030
联系人:杨莉娟
业务联系电话:021-54967202
传真电话:021-54967293
华鑫证券公司网站:www.cfsc.com.cn
客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
(66)中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-8202 3442
传真:0755-8202 6539
客服热线:400 600 8008
公司网址:www.china-invs.cn
(67)九州证券股份有限公司
注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址:深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人:林小明
联系人:聂晗
电话:0755-33331188
传真:0755-33329815
客服热线:4006543218
公司网址:www.tyzq.com.cn
(68)国金证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市东城根上街95号
办公地址:四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:刘婧漪
电话:028-86690057
传真:028-86690126
客服热线:95310
公司网址:www.gjzq.com.cn
(69)华宝证券有限责任公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
法定代表人:陈林
联系人:刘闻川
电话:021-20515589
传真:021-20515593
客服电话:4008209898
公司网址:www.cnhbstock.com
(70)长城国瑞证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
联系人:卢金文
电话:0592-5161642
传真:0592-5161140
客服热线:0592-5163588
公司网址:www.xmzq.com.cn
(71)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号20-25楼
法定代表人:宫龙云
联系人:戴莉丽
电话:021-32229888-25122
传真:021-62878783
客服电话:021-63340678
公司网址:www.ajzq.com

3. 场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单可在深交所网站查询)。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

4. 基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

(二)注册登记机构:
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
电话:010-59378839
传真:010-59378907
联系人:朱立元
(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市君泽君律师事务所
住所:北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼6层
办公地址:北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼6层
负责人:陶修明
电话:010-66523388
传真:010-66523399
经办律师:余红征、王勇
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:天衡会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:南京市建邺区江东中路106号万达广场商务楼B座(14幢)20楼
办公地址:南京市建邺区江东中路106号万达广场商务楼B座(14幢)20楼
法定代表人:余瑞玉
经办注册会计师:谈建忠魏娜
电话:025-84711188
传真:025-84716883

四、基金的名称

本基金名称:东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

本基金类型:上市开放式基金(LOF)

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

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%。

本基金主要投资国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产,货币市场工具包括现金,通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券,期限在一年以内(含一年)的交易所、银行间债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据等。

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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

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。

(一)资产配置策略

1、投资组合久期配置

本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等)和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等)进行分析,预测未来的利率趋势,判断债券市场对上述变量和政策的反应,并据此对投资组合的平均久期进行调整,提高债券组合的总投资收益。

2、期限结构配置

本基金对债券市场收益率期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,预测收益率期限结构的变化方式,选择确定期限结构配置策略,配置各期限固定收益品种的比例,以达到预期投资收益最大化的目的。

3、类属配置

本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

(二)利率品种投资策略

本基金对国债、央行票据等利率品种的投资,是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上,运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测,深入分析利率品种的收益和风险,并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后,本基金对债券的期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,选择合适的期限结构的配置策略,在合理控制风险的前提下,综合考虑组合的流动性,决定投资品种。

(三)信用品种投资策略与信用风险管理

本基金对金融债、企业债、公司债和短期融资券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在组合久期配置策略与期限结构配置策略基础上,运用数量化分析方法对信用产品的信用风险溢价、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析,对利差走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本基金运用行业研究方法和公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。具体而言:

1、根据宏观经济环境及各行业的发展状况,确定各行业的优先配置顺序;

2、研究债券发行人的产业发展趋势、行业政策、公司背景、盈利状况、竞争地位、治理结构、特殊事件风险等基本面信息,分析企业的长期运作风险;

3、运用信用评价系统对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流水平等方面进行综合评价,度量发行人财务风险;

4、利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,确定债券的信用风险等级;

5、综合发行人各方面分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,选择溢价偏高的品种进行投资。

本基金从以下三个方面来进行信用风险管理:

1、进行独立的发行主体信用分析,不断在实践中完善分析方法和积累分析经验数据;

2、严格遵守信用类债券的评级方法,根据不同的信用风险等级,按照公司的投资管理流程和权限管理制度,对相关债券进行定期信用跟踪分析;

3、采取分散化投资策略和集中度限制,严格控制组合整体的信用风险水平。

(四)可转债投资策略

对于本基金中可转债的投资,本基金管理人主要采用可转债相对价值分析策略。

由于可转债兼具债性和股性,其投资风险和收益介于股票和债券之间,可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值,把握可转债的价值走向,选择相应券种,从而获取较高投资收益。

可转债相对价值分析策略首先从可转债的债性和股性分析两方面入手。

本产品用可转债的底价溢价率和可转债的到期收益率来衡量可转债的债性特征。底价溢价率越高,债性特征越弱;底价溢价率越低,则债性特征越强;可转债的到期收益率越高,可转债的债性越强;可转债的到期收益率越低,可转债的股性越强。在实际投资中,可转债的底价溢价率小于10%或到期收益率大于2%的可转债可视为债性较强。

本产品用可转债的平价溢价率和可转债的Delta系数来衡量可转债的股性特征。平价溢价率越高,股性特征越弱;溢价率越低,则股性特征越强。可转债的Delta系数越接近于1,股性越强;Delta系数越远离1,股性越弱。在实际投资中,可转债的平价溢价率小于5%或Delta值大于0.6可视为股性较强。

其次,在进行可转债筛选时,本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果,对可转债的基础股票的基本面进行分析,形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起,最终确定投资的品种。

(五)中小企业私募债投资策略

中小企业私募债券由于该券种的发行主体资质相对较弱,且存在信息透明度较低等问题,因而面临更大的信用风险,属于高风险高收益品种,未来有可能出现债券到期后企业不能按时清偿债务的情况,从而导致基金资产的损失。

本基金将从发行主体所处行业的稳定性、未来成长性,以及企业经营、现金流状况、抵质押及担保增信措施等方面优选信用资质相对较强的高收益债进行投资。严格执行分散化投资策略,分散行业、发行人和区域集中度,以避免行业或区域性事件对组合造成的集体冲击

九、业绩比较基准

中国债券综合全价指数。

中国债券综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围更加全面,具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整,有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念,本基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数作为业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、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。

十一、基金投资组合报告

东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")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。

本基金的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4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2017年9月30日(未经审计)。

1、报告期末基金资产组合情况:

序号	项目	金额(元)	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	154,053,306.72	88.35
	其中:债券	154,053,306.72	88.35
	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	7,000,000.00	4.01
	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	548,858.18	0.31
8	其他资产	12,759,640.84	7.32
9	合计	174,361,805.74	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
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
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。
3、报告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。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	13,088,246.90	9.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	130,848,059.82	97.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,117,000.00	7.54
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	154,053,306.72	114.80

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	136192	16信威01	405,170	39,884,934.80	29.72
2	101554069	15喀斯特旅MTN001	100,000	10,117,000.00	7.54
3	112393	16万维01	100,000	10,045,000.00	7.49
4	112213	14中超债	93,510	9,541,760.40	7.11
5	122212	12京江河	90,060	8,996,093.40	6.70

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。
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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
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
本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明:
9.1 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。
9.2 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。
9.3 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。
10、投资组合报告附注:
(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。
(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。
(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,418.45
2	应收证券清算款	8,200,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,523,979.39
5	应收申购款	12,243.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,759,640.84

(4)报告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。
(5)报告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。
(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。

十二、基金的业绩

本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,也不保证最低收益。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。

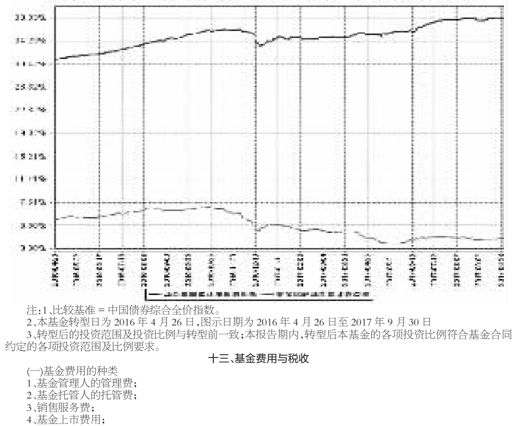
(1)东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

时间	净值增长率%①	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
2016.04.26-2016.12.31	2.30	0.09	-0.73	0.10	3.03	-0.01
2017.01.01-2017.09.30	2.83	0.07	-2.26	0.07	5.09	0.00
2016.04.26-2017.09.30	5.02	0.08	-2.97	0.08	8.17	0.00

注:基金业绩比较基准 = 中国债券综合全价指数,数据截止到2017年9月30日。

(2)自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩基准收益率变动的比较

(2016年4月26日至2017年9月30日)



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9月30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。

十三、基金费用与税收

(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、销售服务费;
4、基金上市费用;
5、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
7、基金份额持有人大会费用;
8、基金的证券交易费用;
9、基金的银行汇划费用;
10、按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.7 %÷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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.2%÷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。

3、销售服务费

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×0.35%÷当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

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。

上述"一、基金费用的种类中第4—10项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(四)与基金销售有关的费用

本基金不收取申购费用。

本基金的场外赎回费率如下表所示:

持有期T	适用的赎回费率
T<90天	0.1%
T≥90天	0

本基金由原有鼎利A、鼎利B份额转入的场外份额不收取赎回费。

本基金的场内赎回费率为固定0.1%。由原有鼎利A、鼎利B份额转入的场内份额赎回费率为固定0.1%。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

(五)不列入基金费用的项目
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、基金合同生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(六)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(七)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、 在"重要提示"中,对相关内容进行了更新。
2、 在"三、基金管理人"中,对相关内容进行了更新。
3、 在"四、基金托管人"中,对相关内容进行了更新。
4、 在"五、相关服务机构"中,对相关内容进行了更新。
5、 在"十、基金的投资"中,对相关内容进行了更新。
6、 在"十一、基金的业绩"中,对相关内容进行了更新。
7、 在"二十三、其他应披露事项"中,更新了其他披露事项:

(1)2017年06月07日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司费率优惠的公告》;

(2)2017年06月08日在中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)更新招募说明书以及摘要》;

(3)2017年07月01日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金2017年半年度资产净值公告》;

(4)2017年07月14日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁(杭州)基金销售有限公司费率优惠活动的公告》;

(5)2017年07月19日在中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)2017年第2季度报告》;

(6)2017年07月19日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增西南证券股份有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》;

(7)2017年07月19日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加西南证券股份有限公司费率优惠的公告》;

(8)2017年08月23日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司改聘会计师事务所公告》;

(9)2017年08月25日在中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)2017年半年度报告》;

(10)2017年09月21日在中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于基金经理因休产假暂停履行职务的公告》;

(11)2017年09月28日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于调整旗下部分深圳证券交易所上市基金场内份额注册登记日期规则的公告》;

(12)2017年10月27日在中国证券报、证券时报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)2017年第3季度报告》。

十五、签署日期

本基金更新招募说明书于2017年12月8日签署。

东吴基金管理有限公司
二零一七年十二月八日

东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金继续暂停申购(含转换转入)业务的提示性公告

公告送出日期:2017年12月8日

1 公告基本信息

基金名称		东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称		东吴安享量化
基金主代码		580007
基金管理人名称		东吴基金管理有限公司
公告依据		根据法律法规及《东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等相关规定。
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2017年2月27日
	暂停转换转入起始日	2017年2月27日
	暂停申购、转换转入的原因说明	为保证东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金的稳定运作,保护基金份额持有人利益,故继续暂停东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金的申购(含转换转入)业务。

2 其他需要提示的事项

(1)东吴基金管理有限公司(以下简称"本公司")已于2017年2月23日发布《东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金暂停申购(含转换转入)的公告》,根据《东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定:"如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次",故发布此提示性公告。

(2)在东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金暂停申购(含转换转入)业务期间,本公司将正常办理该基金的定期定额投资、转换转出、赎回等业务。

(3)本公告仅对本公司管理的东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金暂停申购(含转换转入)业务有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,可通过本公司网站查阅本基金的相关法律文件。

(4)如恢复办理东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金的申购(含转换转入)业务,本公司将另行公告,敬请投资者注意。

(5)本公告涉及上述业务的最终解释权归本公司所有。

本公司承诺依照诚实信用、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,也不保证最低收益。投资有风险,决策需谨慎,投资者申购本基金前,应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

如有疑问,请拨打本公司客户服务热线:400-821-0588,或登陆本公司网站www.scfund.com.cn获取相关信息。

特此公告。

东吴基金管理有限公司
二零一七年十二月八日

东吴配置优化混合型证券投资基金继续暂停申购(含转换转入)业务的提示性公告

公告送出日期:2017年12月8日

1 公告基本信息

基金名称		东吴配置优化混合型证券投资基金
基金简称		东吴配置优化
基金主代码		582003
基金管理人名称		东吴基金管理有限公司
公告依据		根据法律法规及《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》、《东吴配置优化混合型证券投资基金招募说明书》等相关规定。
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2016年12月6日
	暂停转换转入起始日	2016年12月6日
	暂停申购、转换转入的原因说明	为保证东吴配置优化混合型证券投资基金的稳定运作,保护基金份额持有人利益,故继续暂停东吴配置优化混合型证券投资基金的申购(含转换转入)业务。

2 其他需要提示的事项

(1)东吴基金管理有限公司(以下简称"本公司")已于2016年12月3日发布《东吴配置优化混合型证券投资基金暂停申购(含转换转入)的公告》,根据《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》规定:"如发生暂停的时间超过2周,暂停期间,基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次",故发布此提示性公告。

(2)在东吴配置优化混合型证券投资基金暂停申购(含转换转入)业务期间,本公司将正常办理该基金的定期定额投资、转换转出、赎回等业务。

(3)本公告仅对本公司管理的东吴配置优化混合型证券投资基金暂停申购(含转换转入)业务有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,可通过本公司网站查阅本基金的相关法律文件。

(4)如恢复办理东吴配置优化混合型证券投资基金的申购(含转换转入)业务,本公司将另行公告,敬请投资者注意。

(5)本公告涉及上述业务的最终解释权归本公司所有。

本公司承诺依照诚实信用、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,也不保证最低收益。投资有风险,决策需谨慎,投资者申购本基金前,应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

如有疑问,请拨打本公司客户服务热线:400-821-0588,或登陆本公司网站www.scfund.com.cn获取相关信息。

特此公告。

东吴基金管理有限公司
二零一七年十二月八日