

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金
2009 年半年度报告摘要
2009 年 6 月 30 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇〇九年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本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。本半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。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 26 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。

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。

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	3
2.1	基金基本情况.....	3
2.2	基金产品说明.....	3
2.3	基金管理人和基金托管人.....	3
2.4	信息披露方式.....	3
3	主要财务指标和基金净值表现.....	3
3.1	主要会计数据和财务指标.....	3
3.2	基金净值表现.....	3
4	管理人报告.....	3
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	3
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	3
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	3
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	3
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	3
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	3
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	3
5	托管人报告.....	3
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	3
5.2	托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	3
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.....	3
6	半年度财务报表.....	3
6.1	资产负债表.....	3
6.2	利润表.....	3
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	3
6.4	报表附注.....	3
7	投资组合报告.....	3
7.1	期末基金资产组合情况.....	3
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	3
7.3	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.....	3
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	3
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	3
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	3
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明 细.....	3
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	3
7.9	投资组合报告附注.....	3

8	基金份额持有人信息.....	3
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	3
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	3
9	开放式基金份额变动.....	3
10	重大事件揭示.....	3
10.1	基金份额持有人大会决议.....	3
10.2	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.....	3
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	3
10.4	基金投资策略的改变.....	3
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	3
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	3
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	3
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	3

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴双动力股票
交易代码	580002 (前端) 581002 (后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月15日
报告期末基金份额总额	1,609,867,350.46份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对投资对象价值和成长动力的把握，风格动态配置，以资本增值和现金红利的方式获取较高收益。
投资策略	采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、衍生产品、债券和现金上的配置比例。采取自下而上策略，以价值、成长动力为主线，根据东吴价值动力评价体系精选估值处在相对安全边际之内，并且具备良好现金分红能力的价值型股票，和根据东吴成长动力评价体系精选成长性高、公司素质优秀和良好成长型股票作为投资对象。在价值和成长风格配置上，根据未来市场环境判断结果，动态调节投资组合中价值股和成长股的相对比例，降低基金组合投资风险，追求主动投资的超额收益。
业绩比较基准	75%*新华富时A600指数+25%*中信标普全债指数
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的股票型基金，其风险和预期收益均高于混合型基金，在证券投资基金中属于风险较高、收益较高的基金产品。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄忠平	李芳菲
	联系电话	021-50509888-8219	010-68424199
	电子邮箱	huangzhp@scfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		021-50509666	95599
传真		021-50509888-8211	010-68424181

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 主要财务指标和基金净值表现

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	2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
本期已实现收益	313,034,114.23
本期利润	355,901,225.79
加权平均基金份额本期利润	0.2046
本期基金份额净值增长率	23.10%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年 6 月 30 日
期末可供分配基金份额利润	-0.1068
期末基金资产净值	1,793,623,582.70
期末基金份额净值	1.1141

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、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。

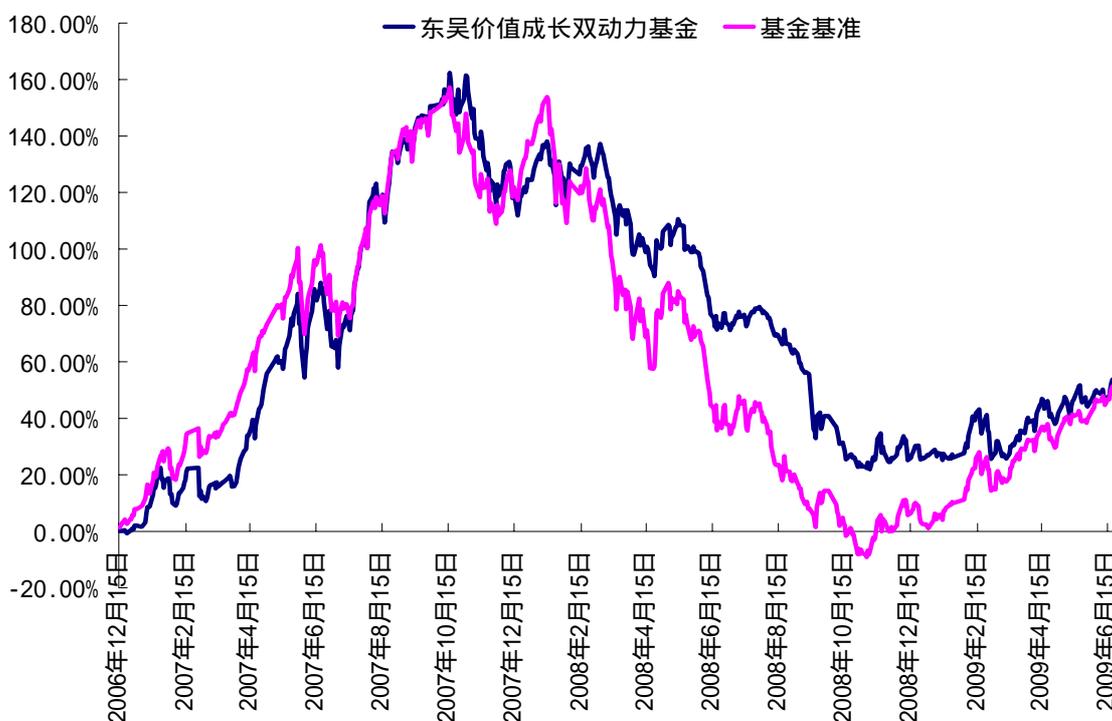
3.2 基金净值表现

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	-	-
过去一个月	8.32%	1.02%	9.53%	0.85%	-1.21%	0.17%
过去三个月	14.24%	1.47%	17.56%	1.14%	-3.32%	0.33%
过去六个月	23.10%	1.59%	53.68%	1.47%	-30.58%	0.12%
过去一年	-9.73%	1.72%	11.54%	1.92%	-21.27%	-0.20%
自基金合同生效起至今	56.19%	1.88%	53.95%	1.94%	2.24%	-0.06%

3.2.2 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比较基准收益率变动的比较

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2006 年 12 月 15 日至 2009 年 6 月 30 日)



注：东吴双动力基金于 2006 年 12 月 15 日成立。

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是经中国证监会证监基金字〔2003〕82 号批准设立的证券投资基金管理公司,于 2004 年 9 月正式成立,注册资本人民币 1 亿元,由东吴证券有限责任公司、上海兰生(集团)有限公司、江阴澄星实业集团有限公司共同发起设立,分别持有 49%、30%、21%的股份。

截至 2009 年 6 月 30 日,本基金管理人于 2005 年 2 月 1 日发起成立并管理第一只基金——东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金;2006 年 12 月 15 日发起成立并管理其第二只基金——东吴价值成长双动力股票型证券投资基金;2008 年 4 月 23 日发起成立并管理第三只基金——东吴行业轮动股票型证券投资基金;2008 年 11 月 5 日发起成立并管理第四只基金——东吴优信稳健债券型证券投资基金;2009 年 5 月 6 日发起成立并管理第五只基金——东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王炯	公司投资总监、本基金的基金经理	2006-5-18	-	12 年	王炯女士,毕业于武汉大学,获硕士学位,12 年证券行业研究和投资经历。曾在 大鹏证券研究所和投资部担任研究员、首席分析师助理等职务,2004 年加入东吴基金。现担任公司投资总监,东吴双动力基金经理、东吴进取策略基金经理。

注:1、此处的任职日期和离职日期均指公司作出决定之日。

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》的相关规定。

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，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定，对基金资产进行合理运作和管理，交易行为合法合规，基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定，无损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资决策、研究分析、投资授权、交易执行、业绩评估等环节严格把关，不断完善公平交易程序及投资、研究、交易等相关业务流程，确保了公平对待旗下不同投资组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

截至本报告期末，本基金为股票型基金，净值增长率为 23.10%，东吴行业轮动股票型证券投资基金为 27.51%。

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说明

2009 年上半年以来，经济景气与企业盈利反弹进一步刺激了投资者的乐观预期，市场走出了超出预期的上扬行情。本基金进一步提高了仓位比例，降低了防御性行业的配置，同时增加了地产、金融等行业的配置比例。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于未来我们这样认为，市场的风险因素主要来自经济见底确认后，对宏观政策调整的风险预期。而房价上升过快已经导致了银行信贷的干预，同时未来宏观指标的增速放缓也将使市场失去继续上行的动力，这种风险无疑是市场趋势发生转折的重要因素。同时市场的估值也并不具有吸引力，这都将资金流入股市的意愿大大减少，这些都将是市场发生调整的重要因素。

资产配置方面，市场从单纯的流动性驱动将转向经济复苏推动，原有的业绩预期能否得到上市公司实际业绩的确认将成为行业配置的重要影响因素。因此，本基金一方面将采取防御的资产配置，另一方面将密切关注经济复苏的进程和通胀的预期，并适时调整未来的资产配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 公司有关参与估值流程各方、组成及职责分工情况：

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总经理、投资总监、运营总监、基金会计、金融工程人员、监察稽核人员组成，同时，督察长、相关基金经理、总经理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，职责分工主要如下：公司总经理、投资总监、投资部负责人及基金经理等参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定；运营总监、基金会计等参与基金组合停牌估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；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；督察长、监察稽核业务相关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。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度：基金经理参与估值委员会对相关停牌股票估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策。

(3) 公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

(4) 公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金实际运作情况，本基金本报告期末可供分配利润为负值，不需进行利润分配。

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

在托管东吴双动力股票型证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《东吴双动力股票型证券投资基金基金合同》、《东吴双动力股票型证券投资基金托管协议》的约定,对东吴双动力股票型证券投资基金管理人—东吴基金管理有限公司 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,东吴基金管理有限公司在东吴双动力股票型证券投资基金的投资运作、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,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的东吴双动力股票型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

6 半年度财务报表

6.1 资产负债表

会计主体：东吴价值成长双动力股票型证券投资基金

报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		55,128,620.57	287,835,143.08
结算备付金		23,593,618.18	13,131,768.76
存出保证金		8,561,001.30	1,863,556.18
交易性金融资产		1,656,426,878.22	1,336,917,897.05
其中：股票投资		1,550,114,878.22	1,036,793,897.05
债券投资		106,312,000.00	300,124,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		67,992,929.56	-
应收利息		3,508,388.00	9,174,079.60
应收股利		302,130.00	-
应收申购款		358,126.65	120,176,974.16
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,815,871,692.48	1,769,099,418.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 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		-	-
应付证券清算款		-	56,597,791.91
应付赎回款		5,009,775.13	1,018,047.71
应付管理人报酬		2,114,351.15	2,042,944.94
应付托管费		352,391.82	340,490.84
应付销售服务费		-	-

应付交易费用		12,456,193.36	7,480,528.28
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		2,315,398.32	2,245,998.51
负债合计		22,248,109.78	69,725,802.19
所有者权益：			
实收基金		1,609,867,350.46	1,877,816,477.29
未分配利润		183,756,232.24	-178,442,860.65
所有者权益合计		1,793,623,582.70	1,699,373,616.64
负债和所有者权益总计		1,815,871,692.48	1,769,099,418.83

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1141 元，基金份额总额 1,609,867,350.46 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴价值成长双动力股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日 - 2008 年 6 月 30 日
一、收入		414,261,623.69	-884,818,976.03
1.利息收入		3,591,301.99	8,014,144.66
其中：存款利息收入		1,085,378.87	3,894,754.71
债券利息收入		2,505,923.12	3,886,510.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	232,879.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		367,237,966.73	-647,735,398.20
其中：股票投资收益		356,510,806.28	-660,368,404.71
债券投资收益		-275,880.00	-694,971.92
资产支持证券投资		-	-
投资收益		-	-
衍生工具收益		-	2,603,331.05
股利收益		11,003,040.45	10,724,647.38
3.公允价值变动收益(损		42,867,111.56	-247,112,333.29

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)		565,243.41	2,014,610.80
二、费用(以“-”号填列)		-58,360,397.90	-106,810,531.91
1. 管理人报酬		-12,731,371.11	-29,189,206.33
2. 托管费		-2,121,895.12	-4,864,867.73
3. 销售服务费		0.00	-
4. 交易费用		-43,264,088.15	-72,362,894.20
5. 利息支出		-34,047.68	-180,749.84
其中：卖出回购金融资产支出		-34,047.68	-180,749.84
6. 其他费用		-208,995.84	-212,813.81
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		355,901,225.79	-991,629,507.94
所得税费用(以“-”号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		355,901,225.79	-991,629,507.94

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：东吴价值成长双动力股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 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)	1,877,816,477.29	-178,442,860.65	1,699,373,616.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	355,901,225.79	355,901,225.79
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)	-267,949,126.83	6,297,867.10	-261,651,259.73
其中：1. 基金申购款	271,317,804.43	-4,184,868.62	267,132,935.81
2. 基金赎回款	539,266,931.26	-10,482,735.72	528,784,195.54

(以“-”号填列)			
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)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	1,609,867,350.46	183,756,232.24	1,793,623,582.70
项目	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30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)	1,930,796,918.95	2,202,243,214.27	4,133,040,133.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	-991,629,507.94	-991,629,507.94
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)	-32,088,849.57	24,116,563.56	-7,972,286.01
其中：1.基金申购款	841,359,940.23	879,534,251.64	1,720,894,191.87
2.基金赎回款(以“-”号填列)	873,448,789.80	855,417,688.08	1,728,866,477.88
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)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	1,898,708,069.38	1,234,730,269.89	3,133,438,339.27

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]173号文《关于同意东吴价值成长双动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准向社会公开发行募集,基金合同于2006年12月15日正式生效。首次设立募集规模为2,144,214,669.67份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为东吴基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%,债券投资比例为基

金资产的 0-35%，现金以及到期日在一年以内债券等短期金融工具资产比例合计不低于基金资产净值的 5%。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金原执行企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》。自 2007 年 7 月 1 日起执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“新会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》(以下简称“指引”)。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金声明：本基金编制的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的财务状况，经营成果和所有者权益(基金净值)变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计政策、会计估计均与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 税项

1、印花税

2007 年 5 月 30 日前按照 0.1%的税率缴纳印花税。

经国务院批准，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券(股票)交易印花税率，由原先的 0.1%调整为 0.3%。

经国务院批准，财政部、国家税务总局批准，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税率，由原先的 0.3%调整为 0.1%。

经国务院批准，财政部、国家税务总局批准，自 2008 年 9 月 19 日起，调整证券(股票)交易印花税，对出让方按 0.1%的税率征收，对受让方不再征税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入,继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

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、国家税务总局财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税,基金向个人投资者分配股息、红利、利息时,不再代扣个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自 2005 年 6 月 13 日起,对证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,按照财税[2005]102 号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按 50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

注：本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券有限责任公司	5,281,656,738.70	18.64%	4,511,430,708.99	21.07%

6.4.7.1.2 权证交易

无。

6.4.7.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30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
东吴证券有限责任公司	-	-	192,184.20	1.71%

6.4.7.1.4 债券回购交易

无。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

东吴证券有限责任公司	4,487,576.49	18.90%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东吴证券有限责任公司	3,807,338.11	21.18%	2,988,032.88	39.72%

注：股票交易佣金为成交金额的 1%扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳。佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年 6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30 日
当期应支付的管理费	12,731,371.11	29,189,206.33
其中：当期已支付	10,617,019.96	24,863,491.13
期末未支付	2,114,351.15	4,325,715.20

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。
其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年 6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30 日
当期应支付的托管费	2,121,895.12	4,864,867.73
其中：当期已支付	1,769,503.30	4,143,915.22
期末未支付	352,391.82	720,952.51

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。
其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

无

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

6.4.7.4.2 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

本基金本报告期内除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.7.5 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 2009年1月1日 - 2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	55,128,620.57	921,160.80	691,811,375.35	3,652,006.81

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期内未持有因认购新发\增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额
000792	盐湖钾肥	2009-6-26	无法按期发布 召开股东大会 通知	55.14	2009-7-27	60.65	400,000	21,551,089.53	22,056,000.00

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期内未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期内未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 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	1,550,114,878.22	85.36
	其中：股票	1,550,114,878.22	85.36
2	固定收益投资	106,312,000.00	5.85
	其中：债券	106,312,000.00	5.85
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	78,722,238.75	4.34
6	其他资产	80,722,575.51	4.45
7	合计	1,815,871,692.48	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采掘业	12,934,024.10	0.72
C	制造业	381,980,979.82	21.30
C0	食品、饮料	47,456,410.00	2.65
C1	纺织、服装、皮毛	11,973,000.00	0.67
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	113,970,439.60	6.35
C5	电子	16,300,000.00	0.91
C6	金属、非金属	44,877,142.46	2.50
C7	机械、设备、仪表	147,403,987.76	8.22
C8	医药、生物制品	0.00	0.00
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应	7,027,314.18	0.39

	业		
E	建筑业	16,192,828.00	0.90
F	交通运输、仓储业	58,724,925.88	3.27
G	信息技术业	5,927,250.83	0.33
H	批发和零售贸易	61,990,190.20	3.46
I	金融、保险业	606,337,866.15	33.81
J	房地产业	377,809,499.06	21.06
K	社会服务业	0.00	0.00
L	传播与文化产业	21,190,000.00	1.18
M	综合类	0.00	0.00
	合计	1,550,114,878.22	86.42

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	2,799,926	138,484,339.96	7.72
2	600030	中信证券	3,899,937	110,212,219.62	6.14
3	600036	招商银行	4,277,680	95,862,808.80	5.34
4	600048	保利地产	3,048,885	85,033,402.65	4.74
5	601601	中国太保	3,743,614	83,782,081.32	4.67
6	000407	胜利股份	8,486,824	77,654,439.60	4.33
7	601628	中国人寿	2,799,328	77,121,486.40	4.30
8	002146	荣盛发展	3,470,595	57,021,875.85	3.18
9	000024	招商地产	1,727,441	54,846,251.75	3.06
10	600383	金地集团	3,156,625	50,884,795.00	2.84

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.scfund.com.cn 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	520,311,528.97	30.62
2	000002	万科A	509,625,875.60	29.99
3	601318	中国平安	410,722,145.41	24.17

4	600837	海通证券	355,336,971.53	20.91
5	601088	中国神华	320,126,546.37	18.84
6	600000	浦发银行	313,042,107.20	18.42
7	601166	兴业银行	249,858,866.43	14.70
8	000001	深发展 A	242,068,862.56	14.24
9	000983	西山煤电	239,035,483.75	14.07
10	601601	中国太保	211,605,368.70	12.45
11	601628	中国人寿	203,334,820.80	11.97
12	600050	中国联通	197,263,412.40	11.61
13	600528	中铁二局	184,856,194.66	10.88
14	000937	金牛能源	184,702,789.47	10.87
15	601168	西部矿业	165,864,926.75	9.76
16	600031	三一重工	161,589,076.64	9.51
17	601898	中煤能源	157,938,046.14	9.29
18	601398	工商银行	153,270,139.25	9.02
19	600036	招商银行	136,992,741.98	8.06
20	000878	云南铜业	133,826,831.50	7.88
21	600089	特变电工	130,424,351.80	7.67
22	000933	神火股份	124,911,970.34	7.35
23	600019	宝钢股份	123,693,395.61	7.28
24	000024	招商地产	123,122,743.60	7.25
25	600048	保利地产	121,817,309.05	7.17
26	601600	中国铝业	116,085,473.71	6.83
27	600383	金地集团	112,382,434.42	6.61
28	000407	胜利股份	109,008,121.56	6.41
29	000858	五粮液	104,334,238.94	6.14
30	600550	天威保变	103,414,579.02	6.09
31	000623	吉林敖东	103,163,284.90	6.07
32	600348	国阳新能	101,776,592.75	5.99
33	601328	交通银行	100,374,184.48	5.91
34	600395	盘江股份	99,911,333.40	5.88
35	000630	铜陵有色	97,190,202.74	5.72
36	600123	兰花科创	96,667,764.84	5.69
37	601666	平煤股份	96,655,939.92	5.69
38	601899	紫金矿业	95,369,150.12	5.61
39	600362	江西铜业	91,641,948.82	5.39
40	600586	金晶科技	90,888,985.90	5.35
41	601699	潞安环能	88,392,989.68	5.20
42	600276	恒瑞医药	84,536,622.27	4.97
43	601001	大同煤业	83,478,669.06	4.91
44	600392	太工天成	80,818,688.87	4.76

45	600549	厦门钨业	78,871,677.06	4.64
46	600188	兖州煤业	78,446,194.30	4.62
47	601919	中国远洋	75,157,016.50	4.42
48	000009	中国宝安	73,185,425.86	4.31
49	000060	中金岭南	72,453,032.46	4.26
50	000012	南玻A	72,423,489.67	4.26
51	600997	开滦股份	70,676,715.75	4.16
52	000031	中粮地产	70,386,366.11	4.14
53	601186	中国铁建	68,737,620.11	4.04
54	600151	航天机电	66,923,759.08	3.94
55	600585	海螺水泥	66,603,741.74	3.92
56	000651	格力电器	65,046,891.57	3.83
57	600143	金发科技	61,729,156.38	3.63
58	000800	一汽轿车	61,542,979.58	3.62
59	600863	内蒙华电	60,594,712.06	3.57
60	600598	北大荒	60,323,196.72	3.55
61	000951	中国重汽	60,263,639.64	3.55
62	000527	美的电器	60,165,896.16	3.54
63	600867	通化东宝	60,087,844.63	3.54
64	600268	国电南自	59,063,735.62	3.48
65	600475	华光股份	59,053,815.23	3.48
66	000400	许继电气	58,898,652.17	3.47
67	000538	云南白药	58,815,553.74	3.46
68	000652	泰达股份	58,713,558.59	3.46
69	600170	上海建工	58,107,464.10	3.42
70	000338	潍柴动力	56,797,020.35	3.34
71	000401	冀东水泥	56,561,400.94	3.33
72	000826	合加资源	54,958,320.15	3.23
73	600517	置信电气	53,447,919.70	3.15
74	000157	中联重科	53,357,628.38	3.14
75	600635	大众公用	53,249,211.10	3.13
76	000686	东北证券	52,823,963.63	3.11
77	600005	武钢股份	52,553,864.95	3.09
78	601988	中国银行	52,119,733.00	3.07
79	600331	宏达股份	51,402,885.39	3.02
80	600066	宇通客车	50,219,151.65	2.96
81	000728	国元证券	49,592,020.78	2.92
82	000839	中信国安	49,125,712.11	2.89
83	600694	大商股份	49,063,441.19	2.89
84	002146	荣盛发展	48,696,245.24	2.87
85	600320	振华重工	48,185,694.80	2.84

86	600639	浦东金桥	48,185,096.18	2.84
87	600221	海南航空	48,178,672.22	2.84
88	000758	中色股份	47,568,563.66	2.80
89	601958	金钼股份	47,466,332.40	2.79
90	600018	上港集团	47,407,735.27	2.79
91	000059	辽通化工	46,959,938.53	2.76
92	600321	国栋建设	46,900,531.64	2.76
93	600236	桂冠电力	46,744,585.75	2.75
94	000679	大连友谊	46,576,547.78	2.74
95	000960	锡业股份	46,408,060.33	2.73
96	600185	*ST 海星	45,989,288.17	2.71
97	600011	华能国际	45,318,841.48	2.67
98	600346	大橡塑	44,732,340.36	2.63
99	000718	苏宁环球	44,626,954.20	2.63
100	600547	山东黄金	43,180,744.60	2.54
101	600120	浙江东方	42,790,812.10	2.52
102	600166	福田汽车	42,765,282.99	2.52
103	000596	古井贡酒	42,164,217.51	2.48
104	600880	博瑞传播	41,622,141.43	2.45
105	600803	威远生化	41,481,496.25	2.44
106	600161	天坛生物	41,438,661.18	2.44
107	600009	上海机场	40,846,365.58	2.40
108	600582	天地科技	40,796,677.84	2.40
109	600104	上海汽车	40,768,724.90	2.40
110	600675	中华企业	40,687,583.29	2.39
111	600900	长江电力	40,641,083.02	2.39
112	600683	银泰股份	40,066,222.71	2.36
113	600875	东方电气	39,313,378.69	2.31
114	600039	四川路桥	39,128,142.82	2.30
115	000948	南天信息	38,504,290.93	2.27
116	002267	陕天然气	38,167,437.37	2.25
117	002266	浙富股份	37,859,300.48	2.23
118	600895	张江高科	37,851,490.17	2.23
119	601872	招商轮船	37,078,462.89	2.18
120	002129	中环股份	36,430,003.33	2.14
121	600649	城投控股	36,021,629.37	2.12
122	000690	宝新能源	35,752,112.75	2.10
123	000069	华侨城 A	35,684,348.78	2.10
124	000969	安泰科技	35,649,285.86	2.10
125	600029	南方航空	35,070,332.43	2.06
126	600059	古越龙山	34,444,246.17	2.03

127	600804	鹏博士	34,193,347.67	2.01
-----	--------	-----	---------------	------

7.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	458,945,768.74	27.01
2	600030	中信证券	413,392,915.35	24.33
3	600837	海通证券	362,196,905.71	21.31
4	600000	浦发银行	323,014,250.59	19.01
5	601088	中国神华	311,956,272.58	18.36
6	601318	中国平安	290,715,092.28	17.11
7	000983	西山煤电	257,087,722.03	15.13
8	000001	深发展A	223,300,874.34	13.14
9	601166	兴业银行	205,827,252.09	12.11
10	600050	中国联通	192,341,926.32	11.32
11	600528	中铁二局	189,475,776.96	11.15
12	000937	金牛能源	188,438,075.51	11.09
13	601398	工商银行	179,199,506.05	10.55
14	601168	西部矿业	172,092,326.31	10.13
15	600276	恒瑞医药	167,740,489.15	9.87
16	600031	三一重工	160,572,667.69	9.45
17	000878	云南铜业	154,070,904.42	9.07
18	601898	中煤能源	150,316,241.64	8.85
19	601601	中国太保	135,566,302.89	7.98
20	600089	特变电工	129,083,866.71	7.60
21	000933	神火股份	128,269,420.20	7.55
22	601628	中国人寿	125,772,985.75	7.40
23	600019	宝钢股份	125,530,110.39	7.39
24	002223	鱼跃医疗	121,961,231.36	7.18
25	601186	中国铁建	117,685,686.09	6.93
26	000630	铜陵有色	108,587,162.62	6.39
27	600123	兰花科创	107,449,499.72	6.32
28	601600	中国铝业	106,870,401.51	6.29
29	000538	云南白药	105,239,110.92	6.19
30	600550	天威保变	104,958,707.23	6.18
31	601699	潞安环能	104,164,155.99	6.13
32	000623	吉林敖东	99,306,273.12	5.84
33	600395	盘江股份	96,100,680.23	5.66
34	601328	交通银行	94,663,726.86	5.57
35	600362	江西铜业	94,444,241.71	5.56

36	600348	国阳新能	94,040,032.04	5.53
37	601001	大同煤业	94,022,131.15	5.53
38	601899	紫金矿业	92,678,204.05	5.45
39	600011	华能国际	92,416,576.88	5.44
40	000858	五粮液	92,242,644.18	5.43
41	601666	平煤股份	92,171,502.17	5.42
42	600392	太工天成	91,239,247.98	5.37
43	600586	金晶科技	87,648,855.26	5.16
44	600997	开滦股份	87,450,413.16	5.15
45	600600	青岛啤酒	86,586,939.57	5.10
46	600549	厦门钨业	83,242,595.05	4.90
47	000012	南玻 A	81,114,633.23	4.77
48	600188	兖州煤业	78,857,629.61	4.64
49	000060	中金岭南	77,023,553.06	4.53
50	600268	国电南自	76,322,860.95	4.49
51	002038	双鹭药业	74,959,005.95	4.41
52	601919	中国远洋	72,827,100.18	4.29
53	000024	招商地产	71,795,381.06	4.22
54	000009	中国宝安	70,331,206.11	4.14
55	600151	航天机电	68,410,684.02	4.03
56	000031	中粮地产	66,920,776.87	3.94
57	600598	北大荒	65,673,671.51	3.86
58	600170	上海建工	64,828,125.69	3.81
59	002238	天威视讯	64,345,790.71	3.79
60	600383	金地集团	62,949,304.27	3.70
61	000800	一汽轿车	62,316,879.98	3.67
62	000338	潍柴动力	61,620,126.73	3.63
63	600331	宏达股份	59,701,898.48	3.51
64	600585	海螺水泥	59,319,068.78	3.49
65	000652	泰达股份	58,249,026.75	3.43
66	600236	桂冠电力	57,811,248.46	3.40
67	000400	许继电气	56,752,926.59	3.34
68	000401	冀东水泥	56,324,059.93	3.31
69	600161	天坛生物	56,280,432.96	3.31
70	600863	内蒙华电	56,192,141.57	3.31
71	600867	通化东宝	55,738,080.69	3.28
72	600143	金发科技	55,612,471.89	3.27
73	600475	华光股份	54,804,806.23	3.23
74	600694	大商股份	53,119,896.67	3.13
75	600635	大众公用	53,005,721.28	3.12
76	000951	中国重汽	52,675,006.36	3.10

77	600018	上港集团	52,229,474.24	3.07
78	601988	中国银行	51,978,386.00	3.06
79	000960	锡业股份	51,955,000.27	3.06
80	600005	武钢股份	51,055,428.45	3.00
81	600639	浦东金桥	50,857,272.20	2.99
82	000758	中色股份	50,477,496.10	2.97
83	600027	华电国际	50,352,275.58	2.96
84	601958	金钼股份	50,012,518.79	2.94
85	000826	合加资源	49,674,357.61	2.92
86	600664	哈药股份	49,227,181.22	2.90
87	601766	中国南车	48,930,292.27	2.88
88	600221	海南航空	48,827,796.60	2.87
89	000728	国元证券	48,788,016.78	2.87
90	000407	胜利股份	48,543,368.84	2.86
91	000839	中信国安	48,301,977.71	2.84
92	000686	东北证券	48,249,339.17	2.84
93	000690	宝新能源	48,154,104.53	2.83
94	601390	中国中铁	48,032,826.04	2.83
95	600517	置信电气	47,397,759.76	2.79
96	000059	辽通化工	47,075,956.23	2.77
97	600185	*ST 海星	46,956,801.55	2.76
98	600036	招商银行	45,937,867.75	2.70
99	600048	保利地产	45,854,994.03	2.70
100	000651	格力电器	45,097,378.02	2.65
101	600066	宇通客车	45,061,338.49	2.65
102	600312	平高电气	44,620,274.69	2.63
103	600320	振华重工	44,461,003.66	2.62
104	600166	福田汽车	44,172,487.64	2.60
105	600380	健康元	43,984,801.98	2.59
106	600321	国栋建设	43,770,408.45	2.58
107	600803	威远生化	42,732,540.82	2.51
108	600582	天地科技	42,697,990.29	2.51
109	600547	山东黄金	42,621,532.32	2.51
110	600795	国电电力	42,253,846.41	2.49
111	600675	中华企业	41,939,688.28	2.47
112	601872	招商轮船	41,842,055.97	2.46
113	600104	上海汽车	41,832,227.86	2.46
114	600346	大橡塑	41,708,205.89	2.45
115	600804	鹏博士	41,555,359.72	2.45
116	600432	吉恩镍业	41,324,696.07	2.43
117	600900	长江电力	41,289,499.90	2.43

118	600880	博瑞传播	40,673,738.99	2.39
119	600039	四川路桥	40,490,444.99	2.38
120	600029	南方航空	40,149,877.00	2.36
121	600649	城投控股	39,679,198.54	2.33
122	600396	金山股份	39,539,760.07	2.33
123	600875	东方电气	38,834,482.10	2.29
124	000527	美的电器	38,520,835.50	2.27
125	600741	华域汽车	38,007,421.41	2.24
126	600895	张江高科	36,909,045.08	2.17
127	000948	南天信息	36,605,694.00	2.15
128	600120	浙江东方	36,528,239.99	2.15
129	000157	中联重科	36,271,518.17	2.13
130	000069	华侨城 A	36,076,239.26	2.12
131	002015	霞客环保	35,906,159.71	2.11
132	002267	陕天然气	35,831,882.71	2.11
133	000969	安泰科技	35,656,892.88	2.10
134	600405	动力源	35,378,455.21	2.08
135	000911	南宁糖业	35,375,675.50	2.08
136	600316	洪都航空	34,729,566.23	2.04
137	600068	葛洲坝	34,559,876.37	2.03
138	600059	古越龙山	34,077,104.26	2.01

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	14,221,352,403.87
卖出股票的收入（成交）总额	14,108,988,360.54

注：上述内容，按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	-	-
2	央行票据	106,312,000.00	5.93
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	106,312,000.00	5.93

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	0801106	08 央票 106	500,000	48,360,000.00	2.70
2	0801092	08 央票 92	500,000	48,220,000.00	2.69
3	0801114	08 央票 114	100,000	9,732,000.00	0.54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,561,001.30
2	应收证券清算款	67,992,929.56
3	应收股利	302,130.00
4	应收利息	3,508,388.00
5	应收申购款	358,126.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,722,575.51

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

8 基金份额持有人信息**8.1 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
95,300	16,892.63	118,443,487.93	7.36%	1,491,423,862.53	92.64%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本基金报告期末基金管理人的从业人员未持有开放式基金。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	2,144,214,669.67
报告期期初基金份额总额	1,877,816,477.29
报告期期间基金总申购份额	271,317,804.43
报告期期间基金总赎回份额	539,266,931.26
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,609,867,350.46

10 重大事件揭示**10.1 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决议。

10.2 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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为江苏公正天业会计师事务所，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东吴证券	2	5,281,656,738.70	18.64%	-	-
国信证券	1	1,573,311,760.98	5.55%	-	-
中信证券	1	2,646,366,035.48	9.34%	-	-
招商证券	1	1,289,939,141.50	4.55%	-	-
东方证券	1	2,189,343,638.51	7.73%	-	-
银河证券	1	606,269,279.87	2.14%	-	-
高华证券	1	368,219,098.85	1.30%	-	-
中银国际	1	1,678,772,070.87	5.93%	-	-

中信建投	1	168,615,577.29	0.60%	-	-
中金公司	1	4,706,225,445.87	16.61%	-	-
国元证券	1	642,773,681.11	2.27%	-	-
申银万国	1	1,758,878,621.24	6.21%	-	-
国金证券	1	1,108,755,320.66	3.91%	-	-
江南证券	1	1,140,947,590.47	4.03%	-	-
齐鲁证券	1	780,784,820.37	2.76%	-	-
中投证券	1	851,992,238.36	3.01%	-	-
东海证券	1	878,178,821.98	3.10%	-	-
安信证券	1	659,310,882.30	2.33%	-	-
合计	19	28,330,340,764.41	100.00%	-	-

券商名称	回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
	成交金额	占当期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	佣金	占当期佣金总量的比例
东吴证券	-	-	-	-	4,487,576.49	18.90%
国信证券	-	-	-	-	1,337,299.93	5.63%
中信证券	-	-	-	-	2,150,196.05	9.06%
招商证券	-	-	-	-	1,048,093.50	4.42%
东方证券	-	-	-	-	1,778,867.90	7.49%
银河证券	-	-	-	-	492,600.64	2.08%
高华证券	-	-	-	-	299,181.31	1.26%
中银国际	-	-	-	-	1,426,943.89	6.01%
中信建投	-	-	-	-	143,320.82	0.60%
中金公司	-	-	-	-	4,000,266.73	16.85%
国元证券	-	-	-	-	546,359.99	2.30%
申银万国	-	-	-	-	1,495,037.86	6.30%
国金证券	-	-	-	-	942,444.33	3.97%
江南证券	-	-	-	-	927,032.53	3.91%
齐鲁证券	-	-	-	-	663,659.69	2.80%
中投证券	-	-	-	-	692,253.44	2.92%
东海证券	-	-	-	-	746,448.54	3.14%
安信证券	-	-	-	-	560,411.01	2.36%
合计	-	-	-	-	23,737,994.65	100.00%

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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

本报告期本基金无新租用交易单元。

11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司
二〇〇九年八月二十七日