
东吴价值成长双动力股票型证券投资基金
2009 年年度报告
2009 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一〇年三月二十七日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 23 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。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
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.....	11
§6 审计报告.....	11
6.1 管理层对财务报表的责任.....	11
6.2 注册会计师的责任.....	11
6.3 审计意见.....	12
§7 年度财务报表.....	12
7.1 资产负债表.....	12
7.2 利润表.....	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
7.4 报表附注.....	16
§8 投资组合报告.....	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
8.6 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.....	49
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	49

8.8 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	50
8.9 投资组合报告附注	50
§9 基金份额持有人信息	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	51
§10 开放式基金份额变动	51
§11 重大事件揭示	51
11.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4 基金投资策略的改变	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
11.8 其他重大事件	53
§12 影响投资者决策的其他重要信息	56
§13 备查文件目录	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴价值成长双动力股票型证券投资基金	
基金简称	东吴双动力股票	
基金主代码	580002	
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	
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	
报告期末基金份额总额	1,484,245,496.49份	
基金合同存续期	不定期	

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
注册地址		上海浦东源深路279号	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海浦东源深路279号	北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦

邮政编码	200135	100048
法定代表人	徐建平	项俊波

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	江苏公证天业会计师事务所有限公司	江苏省苏州市新市路130号
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东新区源深路279号

§ 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	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	429,049,499.37	-1,530,812,536.30	1,874,600,303.33
本期利润	498,751,599.41	-1,610,048,462.96	1,984,263,323.28
加权平均基金份额本期利润	0.3021	-0.8421	1.0008
本期加权平均净值利润率	28.41%	-54.53%	56.25%
本期基金份额净值增长率	33.20%	-43.47%	120.03%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配利润	-44,343,758.09	-538,765,326.07	1,805,554,493.16
期末可供分配基金份额利润	-0.0299	-0.2869	0.9351
期末基金资产净值	1,789,238,743.90	1,699,373,616.64	4,133,040,133.22
期末基金份额净值	1.2055	0.9050	2.1406
3.1.3 累计期末指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
基金份额累计净值增长率	69.00%	26.87%	124.43%

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①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	18.50%	1.60%	14.93%	1.31%	3.57%	0.29%
过去六个月	8.20%	1.81%	10.73%	1.59%	-2.53%	0.22%
过去一年	33.20%	1.71%	72.09%	1.53%	-38.89%	0.18%
过去三年	65.69%	1.88%	58.36%	1.89%	7.33%	-0.01%
自基金合同生效起至今	69.00%	1.87%	72.09%	1.88%	-3.09%	-0.01%

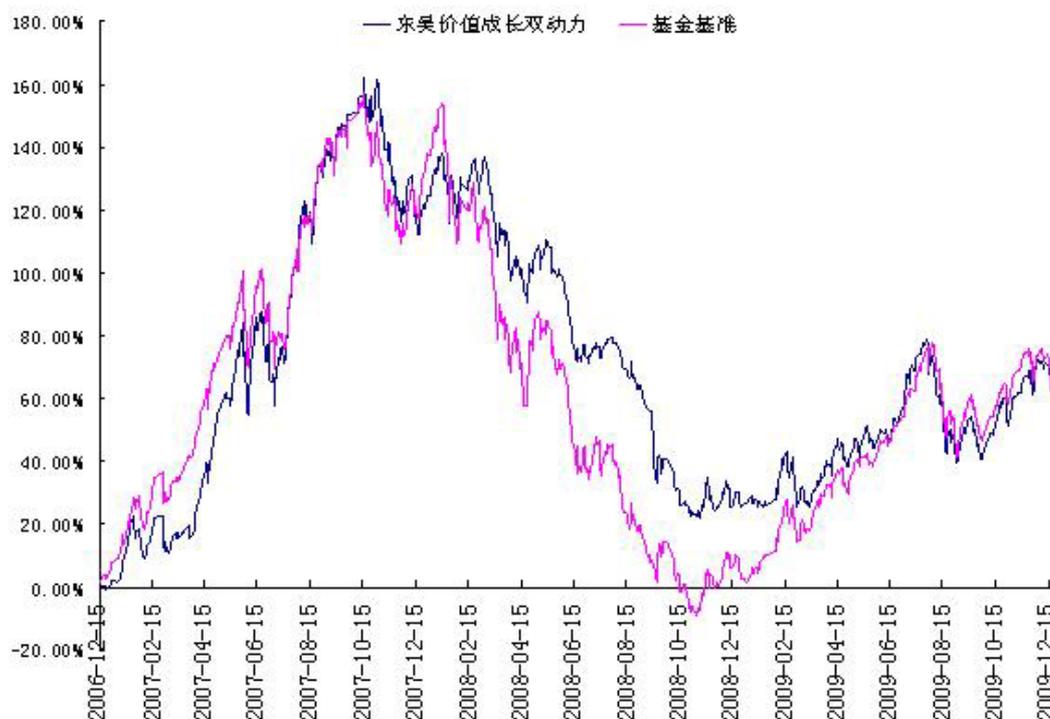
注：比较基准=75%*新华富时 A600 指数+25%*中信标普全债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 12 月 31 日)

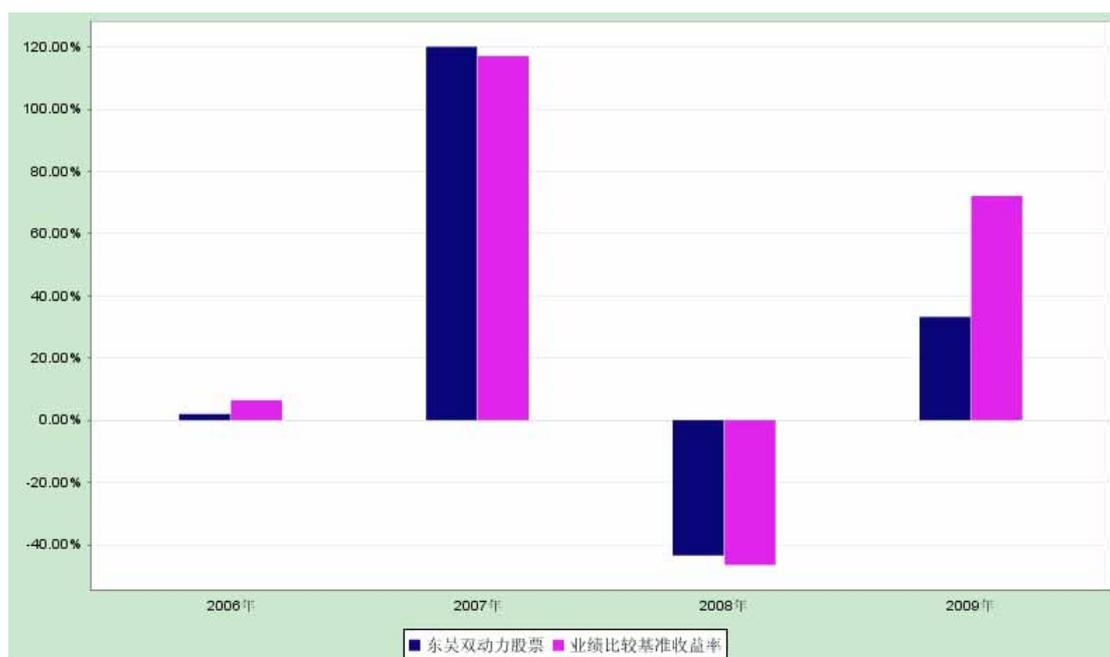


注：东吴双动力基金于 2006 年 12 月 15 日成立。

3.2.3 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比较

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：东吴价值成长双动力基金于 2006 年 12 月 15 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009	-	-	-	-	-
2008	4.200	330,067,520.99	423,685,234.01	753,752,755.00	本期分红一次
2007	1.000	91,326,545.94	117,239,027.80	208,565,573.74	本期分红一次
合计	5.200	421,394,066.93	540,924,261.81	962,318,328.74	-

§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 12 月 31 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；2009 年 12 月 30 日发起成立并管理第六只基金——东吴新经济股票型证券投资基金。

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	2006-12-15	-	12 年	王炯女士，12 年证券行业研究和投资经历。毕业于武汉大学，获硕士学位，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、其为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金合同生效日。

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，在严格控制风险的基础上，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，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。

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 33.20%，东吴行业轮动股票型

证券投资基金为 42.10%。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

转眼之间，世界金融危机已过去一年多。从中国证券市场来看，2009 年走出较为明显的政策刺激加信贷巨额投放下的上涨行情，上证综指从 1820.81 点起步，8 月初指数创出年内最高的 3478.01 点，此后总体上在 3000 点上方震荡，截至 09 年 12 月 28 日上证指数年涨幅达到 75.13%，为历史上第五大年涨幅。从 2009 年整个宏观经济政策来看，全年基本上坚持着“保八，促增长”这样的市场环境中运行，随着上市公司业绩出现回暖，进而影响到 A 股市场总体呈现了快速上涨。由于对百年难遇的金融危机在政策的刺激下 V 型反转反应迟缓，本基金采取了保守的投资策略，错过了 2009 年一二季度最迅猛的单边上涨行情，同时对与经济敏感度较高的周期性行业配置不够，基金净值表现弹性不佳，增长较为平缓，落后大盘。

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 1.2055 元，本报告期份额净值增长率 33.20%；同期业绩比较基准增长率为 72.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2010 年的市场环境面临诸多的不确定因素，通胀、需求、库存方面的压力使得经济形势并不明朗，实体经济在政策退出后的表现是否如市场预期的强劲，紧缩的政策是否会损坏经济的复苏，在这些担忧下 A 股市场难以形成趋势性的上涨动力。我们在投资上相对偏谨慎一些。

2010 年的政策既要保增长、又要防通胀、还要调结构，调结构是政策未来的主要方向，A 股市场也将会围绕着“调结构”而演绎，我们投资的总体方向应当与之相匹配。看好节能减排、资产整合、居民消费以及新技术和新产业等所孕育的成长股的机会。

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，本基金管理人在完善公司治理结构、内部控制制度和流程体系的同时，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；强化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、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。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监察稽核报告。

本报告期内，重点开展的监察稽核工作包括：

(1) 加强制度建设。根据有关法律、法规的要求，公司进一步修订完善了相关规章制度及业务流程，促进公司规范化经营，有效防范和化解风险。

(2) 加强合规监察力度。根据公司年度监察稽核工作计划的安排，对公司各项业务的合规性和内部管理制度及流程执行情况进行定期监察，强化各部门对制度和流程的执行力。

(3) 促进合规文化建设。对公司员工开展较全面的业务培训，以加强公司员工的合规意识，有利于公司长远稳定地发展。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同约定，基金当期收益应先弥补前期亏损后，才可进行当年收益分配，本基金不满足收益分配条件，本年度无应分配但未分配利润。

§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

在托管东吴价值成长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》相关法律法规的规定以及《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金合同》、《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金托管协议》的约定,对东吴价值成长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 12 月 31 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合规守信、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价值成长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、基金费用开支及利润分配等问题上,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价值成长双动力股票型证券投资基金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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

苏公 W[2010]A 229 号

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的东吴价值成长双动力股票型证券投资基金(以下简称“双动力基金”)财务报表,包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年度的利润表、所有者权益(基金净额)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表是双动力基金的基金管理人东吴基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;(2)选择和运用恰当的会计政策;(3)作出合理的会计估计。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,双动力基金财务报表已经按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制,在所有重大方面公允反映了双动力基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和所有者权益(基金净值)变动分配情况。

江苏公证天业会计师事务所有限公司

中国注册会计师 叶水林

中国·无锡

中国注册会计师 吕卫星

二〇一〇年三月十五日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2009年12月31日	2008年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	427,859,427.80	287,835,143.08
结算备付金		6,900,012.48	13,131,768.76
存出保证金		5,333,360.31	1,863,556.18
交易性金融资产	7.4.7.2	1,354,249,222.28	1,336,917,897.05
其中：股票投资		1,301,773,477.64	1,036,793,897.05
基金投资		-	-
债券投资		52,475,744.64	300,124,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		8,265,257.49	-
应收利息	7.4.7.5	126,660.32	9,174,079.60
应收股利		-	-
应收申购款		181,518.91	120,176,974.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,802,915,459.59	1,769,099,418.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年12月31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		1,766,565.49	56,597,791.91
应付赎回款		2,813,948.49	1,018,047.71
应付管理人报酬		2,292,441.48	2,042,944.94
应付托管费		382,073.57	340,490.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,014,555.07	7,480,528.28
应交税费		2,208.00	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,404,923.59	2,245,998.51
负债合计		13,676,715.69	69,725,802.19
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,484,245,496.49	1,877,816,477.29
未分配利润	7.4.7.10	304,993,247.41	-178,442,860.65
所有者权益合计		1,789,238,743.90	1,699,373,616.64
负债和所有者权益总计		1,802,915,459.59	1,769,099,418.83

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2055 元，基金份额总额 1,484,245,496.49 份。

7.2 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 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年1 2月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年1 2月31日
一、收入		592,077,382.53	-1,466,491,118.83
1. 利息收入		5,509,613.76	17,544,184.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,909,913.57	5,515,633.30
债券利息收入		3,599,700.19	11,664,917.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	363,633.26
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		516,103,842.88	-1,407,772,344.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	504,511,073.90	-1,428,328,163.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-649,807.91	-662,084.57
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益		-	5,667,062.72
股利收益	7.4.7.15	12,242,576.89	15,550,841.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	69,702,100.04	-79,235,926.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	761,825.85	2,972,967.44
减：二、费用		93,325,783.12	143,557,344.13
1. 管理人报酬		26,218,432.70	44,542,409.74
2. 托管费		4,369,738.75	7,423,735.01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	62,198,614.69	90,955,495.86
5. 利息支出		119,559.34	211,819.39
其中：卖出回购金融资产支		119,559.34	211,819.39

出			
6. 其他费用	7. 4. 7. 19	419,437.64	423,884.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		498,751,599.41	-1,610,048,462.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		498,751,599.41	-1,610,048,462.96

7.3 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 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009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）	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）	-	498,751,599.41	498,751,599.41
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）	-393,570,980.80	-15,315,491.35	-408,886,472.15
其中：1. 基金申购款	402,664,390.05	20,250,131.85	422,914,521.90
2. 基金赎回款	-796,235,370.85	-35,565,623.20	-831,800,994.05
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）	1,484,245,496.49	304,993,247.41	1,789,238,743.90
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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）	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）	-	-1,610,048,462.96	-1,610,048,462.96
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）	-52,980,441.66	-16,884,856.96	-69,865,298.62
其中：1. 基金申购款	1,485,422,761.86	995,595,139.32	2,481,017,901.18
2. 基金赎回款	-1,538,403,203.52	-1,012,479,996.28	-2,550,883,199.80
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）	-	-753,752,755.00	-753,752,755.00
五、期末所有者权益（基金净值）	1,877,816,477.29	-178,442,860.65	1,699,373,616.64

注：报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：徐建平，主管会计工作负责人：黄忠平，会计机构负责人：金婕

7.4 报表附注

7.4.1 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%。本基金的业绩比较基准=75%*新华富时A600指数+25%*中信标普全债指数。

7.4.2 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”)。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本报告编制期间为2009年1月1日至12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分

为以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。除与权证投资有关的金融资产外，以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示，与权证投资有关的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资分类为以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融资产。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款与应收款项。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融负债和其他金融负债。除与权证投资有关的金融负债外，以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示；与权证投资有关的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金目前持有的金融负债全部为其他金融负债，包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

(1) 金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量。

对于交易性金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益，对于应收款项类金融资产和其他金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。具体各类金融工具的初始计量方法如下：

A、股票投资

股票投资成本按成交日股票的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股票完成股权分置改革后的第一个交易日入账，冲减该股票投资成本。

B、债券投资

债券投资成本于成交日按债券的公允价值（不含应收利息）入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

认购新发行的可分离债，按照估值方法对可分离债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次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。

C、权证投资

权证投资成本于成交日按应支付的全部价款入账。

因股权分置改革而获赠的权证，在确认日按照持有股数和每股可获派发权证的份额确认权证数量，成本为零。

因认购新发行的可分离债而取得的权证，按照估值方法对可分离债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

D、买入返售金融资产

买入返售金融资产反映本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的证券等金融资产所融出的资金。买入返售证券于成交日按照应付或实际支付的金额入账。

E、卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款反映本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入的票据、证券等金融资产所融入的资金。卖出回购证券于成交日按照应收或实际收到的金额入账。

(2) 金融工具的后续计量

本基金持有的金融资产和金融负债的后续计量与其分类相关联。对于以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融资产或金融负债，按照公允价值后续计量，公允价值变动记入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，采用实际利率法，按摊余成本计量。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

交易性金融资产和金融负债，按估值日的公允价值进行后续计量，公允价值的变动计入当期损益。对于应收款项类金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。有客观证据表明按摊余成本计量的金融资产发生减值的，计提减值准备。将其账面价值减记至预计未来现金流量现值，减记金额确认为减值损失，计入当期损益。金融资产在确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，金融资产转回减值损失后的账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。具体各类金融工具的公允价值确定方法如下：

A、股票投资

对存在活跃市场的投资品种，估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事

件的，应采用最近交易市价确定公允价值。估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。首次于交易所发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价作为公允价值。

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按交易所上市的同一股票的市价作为公允价值。非公开发行有明确锁定期的股票，初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价的，按交易所上市的同一股票的市价为基础的估值方法确定公允价值。

B、债券投资

交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价为公允价值。估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应采用最近交易日收盘价确定公允价值。估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

首次于交易所发行未上市的债券及认购可分离债所获得的债券在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

全国银行间同业市场交易的债券采用估值技术确定公允价值。

同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别确定公允价值。

C、权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应采用最近交易日收盘价确定公允价值。估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

认购可分离债所获得的债券在交易所上市交易前,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本计量。

交易所停止交易等非流通品种的估值。因持有股票而享有的配股权,以及停止交易、但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。

D、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价格估值。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,且目前可执行该种法定权利,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。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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未分配利润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认列,并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 股票投资收益/(损失)

股票投资收益/(损失)为以下两者的合计数。(A) 卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本、估值增值或减值的差额。(B) 原计入损益的该股票投资的公允价值变动金额。

(2) 债券投资收益/(损失)

债券投资收益/(损失)为以下两者的合计数。(A) 卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、估值增值或减值与应收利息(若有)的差额。(B) 原计入损益的该债券投资的公允价值变动金额。

(3) 存款利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(4) 债券利息收入

债券利息收入在持有债券期间,按债券投资的票面利率计算的利息,每日确认利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,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,确认利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,则按实际利率计算债券利息收入。如相关法规规定对本基金收到的债券利息扣税的,本基金在确认债券利息收入、收到派息款等业务环节时,考虑适用税率等因素。

(5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

(6) 股利收入

持有股票期间上市公司宣告发放的现金股利,按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认股票投资收益。

(7) 其他收入

于实际收到时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率逐日计提;
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。
- (3) 卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提;
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议的规定,按实际支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 每一基金份额享有同等分配权;
- (2) 投资者可以选择现金分红或红利再投资方式,以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准,投资者选择分红的默认方式为现金分红;
- (3) 基金投资当年亏损,则不进行收益分配;
- (4) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;
- (5) 基金当期收益应先弥补前期亏损后,才可进行当年收益分配;
- (6) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至多分配八次,至少分配一次,但若成立不满 3 个月可不进行收益分配;
- (7) 全年合计的基金收益分配比例不得低于本基金年度已实现净收益的 50%;

(8) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金持有的长期停牌股票盐湖钾肥 2009 年 1 月 5 日交易特征已能公允反映该股票价值，经与托管行协商一致，自 2009 年 1 月 5 日起对盐湖钾肥股票由指数收益法恢复按市价估值法进行估值。该事项已根据有关规定于 2009 年 1 月 6 日予以了信息披露。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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)交易印花税率，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
活期存款	427,859,427.80	287,835,143.08
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	427,859,427.80	287,835,143.08

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,167,677,642.94	1,301,773,477.64	134,095,834.70	
债券	交易所市场	1,763,200.00	2,640,744.64	877,544.64

	银行间市场	49,835,000.00	49,835,000.00	-
	合计	51,598,200.00	52,475,744.64	877,544.64
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,219,275,842.94	1,354,249,222.28	134,973,379.34
项目	上年度末 2008 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		973,252,727.75	1,036,793,897.05	63,541,169.30
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	298,393,890.00	300,124,000.00	1,730,110.00
	合计	298,393,890.00	300,124,000.00	1,730,110.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,271,646,617.75	1,336,917,897.05	65,271,279.30

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应收活期存款利息	81,966.33	54,568.53
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,415.00	5,909.30
应收债券利息	42,211.99	9,111,153.60
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	67.00	2,448.17
其他	-	-
合计	126,660.32	9,174,079.60

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,013,870.22	7,478,078.68
银行间市场应付交易费用	684.85	2,449.60
合计	4,014,555.07	7,480,528.28

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	2,000,000.00	1,750,000.00
应付赎回费	14,923.59	5,998.51
预提审计费	90,000.00	90,000.00
预提信息披露费	300,000.00	400,000.00
合计	2,404,923.59	2,245,998.51

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,877,816,477.29	1,877,816,477.29
本期申购	402,664,390.05	402,664,390.05
本期赎回（以“-”号填列）	-796,235,370.85	-796,235,370.85
本期末	1,484,245,496.49	1,484,245,496.49

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则本期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，则本期赎回份额中包含该业务份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-538,765,326.07	360,322,465.42	-178,442,860.65
本期利润	429,049,499.37	69,702,100.04	498,751,599.41
本期基金份额交易产生的变动数	65,372,068.61	-80,687,559.96	-15,315,491.35
其中：基金申购款	-60,900,161.89	81,150,293.74	20,250,131.85
基金赎回款	126,272,230.50	-161,837,853.70	-35,565,623.20

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-44,343,758.09	349,337,005.50	304,993,247.41

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31 日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
活期存款利息收入	1,653,513.88	5,189,196.82
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	225,961.75	228,624.38
其他	30,437.94	97,812.10
合计	1,909,913.57	5,515,633.30

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	20,496,803,739.55	16,718,845,498.84
减：卖出股票成本总额	19,992,292,665.65	18,147,173,662.78
买卖股票差价收入	504,511,073.90	-1,428,328,163.94

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月 31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	471,511,500.66	813,666,243.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	457,068,994.38	798,017,541.02
减：应收利息总额	15,092,314.19	16,310,787.54
债券投资收益	-649,807.91	-662,084.57

7.4.7.14 衍生工具收益**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
卖出权证成交总额	-	103,379,228.27

减：卖出权证成本总额	-	97,712,165.55
买卖权证差价收入	-	5,667,062.72

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31 日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
股票投资产生的股利收益	12,242,576.89	15,550,841.76
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	12,242,576.89	15,550,841.76

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31 日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
1. 交易性金融资产	69,702,100.04	-79,235,926.66
——股票投资	70,554,665.40	-81,037,796.66
——债券投资	-852,565.36	1,801,870.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	69,702,100.04	-79,235,926.66

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
基金赎回费收入	628,894.86	2,945,837.96
印花税手续费返还	78,486.30	27,129.48
转换费收入	54,444.69	-
合计	761,825.85	2,972,967.44

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	62,196,714.69	90,950,620.86
银行间市场交易费用	1,900.00	4,875.00
合计	62,198,614.69	90,955,495.86

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
汇划费	21,437.64	25,884.13
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	-	-
合计	419,437.64	423,884.13

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

无需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
江阴澄星实业集团有限公司	基金管理人的股东

注：本报告期基金关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2009年1月1日至2009年12月31日		2008年1月1日至2008年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东吴证券有限责任公司	8,829,847,710.36	21.71%	8,362,849,112.27	25.86%

7.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	-	-	4,466,140.98	2.28%

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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
东吴证券有限责任公司	-	-	16,662,536.00	15.26%

7.4.10.1.4 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日至2009年12月31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	7,471,753.19	21.92%	725,292.59	18.07%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	7,060,208.97	26.00%	1,656,347.72	22.15%

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。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31
----	----------------------------	---------------------------------

	日	日
当期发生的基金应支付的管理费	26,218,432.70	44,542,409.74
其中：支付销售机构的客户维护费	3,743,806.55	6,029,199.70

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,369,738.75	7,423,735.01

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人本报告期内及上年度均未持有本基金份额。

7.4.10.4.2 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

本基金报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2009年1月1日至2009年12月31日		2008年1月1日至2008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
中国农业银行股份有限公司	427,859,427.80	1,653,513.88	287,835,143.08	5,189,196.82

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601117	中国化学	2009-12-29	2010-01-07	新股未上市	5.43	5.43	14,000	76,020.00	76,020.00	-
002308	威创股份	2009-11-18	2010-03-01	新股网下申购锁定期内	23.80	31.83	10,659	253,684.20	339,275.97	-
300015	爱尔眼科	2009-10-15	2010-02-01	新股网下申购锁定期内	28.00	48.80	23,026	644,728.00	1,123,668.80	-
300041	回天胶业	2009-12-28	2010-01-08	新股未上市	36.40	36.40	500	18,200.00	18,200.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	备注
600102	莱钢股份	2009-11-09	因重大资产重组事项停牌	13.07	2010-02-24	11.88	1,340,219	16,674,337.11	17,516,662.33	-
600739	辽宁成大	2009-12-28	因重大资产重组事项停牌	38.09	2010-01-11	41.90	270,579	10,648,747.99	10,306,354.11	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票、债券、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过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。

本基金采取自上而下策略，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。

本基金管理人根据基金管理业务的特点，设立顺序递进、权责统一、严密有效的三级风险控制组织体系。董事会层面主要负责公司的风险管理战略和控制政策等事项；公司经营管理层下设投资决策委员会、风险管理委员会和监察稽核部对经营风险进行预防和控制，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责各自业务领域风险的管控。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他应收类款项。报告期内，本基金持有的金融资产均未发生逾期与减值的情况。

对于与债券投资的信用风险，本基金管理人的投资部门及交易部门建立了经审批的交易对手名单，并通过限定被投资对象的信用等级范围及各类投资品种比例上来管理信用风险。报告期末，本基金持有比例较低的央票和公司可转债，信用风险程度低。

本基金的银行存款存放于本基金的托管行—中国农业银行股份有限公司。本基金认为与中国农业银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。作为开放式基金，存在兑付赎回资金的流动性风险。本基金流动风险亦来源于因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。

本基金报告期末持仓组合平均流通股本低于 A 股市场平均流通股本。与此同时，基金持仓组合的换手率为 3.51%（剔除未上市流通股）。总体上看，持仓组合投资对象流动性较好。另外，本基金持仓市值占本基金组合流通市值和 A 股市场流通市值比例分别为 0.15% 和 0.01%，比例很低，对市场冲击有限。根据以上流动性指标判断，本基金流动性风险很低。本基金管理人通过对投资品种的流动性指标监控来评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。本基金管理人通过基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

表 1 东吴双动力基金持仓组合流动性结果表

日期	平均流通股 本（亿股）	A股平均流通 股本（亿股）	持仓组合日 均换手率	持仓市值占组 合流通市值比 例	占A股市场流 通市值比例
2009.12.31	6.06	8.16	3.51%	0.15%	0.01%

注：数据来源为根据 Wind 系统计算得到。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

从风险表现看，报告期内东吴双动力日标准差为 1.71%，同期基金基准为 1.53%，衡量

系统风险的 Beta 系数为 1.02。在报告期内，东吴双动力风险略高于基金基准。

从经总体风险调整后收益表现看，东吴双动力 Sharpe 比率为 1.16，同期基金基准为 2.92，东吴双动力基金的 Sharpe 比率低于基金基准。

表 2 东吴双动力 2009 年风险指标

	东吴双动力基金	基金基准
日标准差	1.71%	1.53%
Beta	1.02	
Sharpe Ratio	1.16	2.92

注：比较基准=75%*新华富时 A600 指数+25%*中信标普全债指数。

从 VAR 风险指标来看，采用历史模拟法计算基金的 VAR，样本为报告期间东吴双动力基金单位净值的日收益率，样本容量为 244。报告期末不同置信水平下基金的 VAR 为：

90%的置信水平 VAR 值为 1.18%；

95%的置信水平 VAR 值为 1.86%；

99%的置信水平 VAR 值为 2.28%。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资、银行存款、与买入返售金融资产。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5 年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	427,859,427.80	-	-	-	-	-	427,859,427.80
结算备付金	6,900,012.48	-	-	-	-	-	6,900,012.48
存出保证	-	-	-	-	-	5,333,360.31	5,333,360.31

金							
交易性金融资产	-	49,835,000.00	-	-	2,640,744.64	1,301,773,477.64	1,354,249,222.28
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,265,257.49	8,265,257.49
应收利息	-	-	-	-	-	126,660.32	126,660.32
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	181,518.91	-	-	-	-	-	181,518.91
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	434,940,959.19	49,835,000.00	-	-	2,640,744.64	1,315,498,755.76	1,802,915,459.59
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,766,565.49	1,766,565.49
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,813,948.49	2,813,948.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,292,441.48	2,292,441.48
应付托管费	-	-	-	-	-	382,073.57	382,073.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,014,555.07	4,014,555.07
应交税费	-	-	-	-	-	2,208.00	2,208.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,404,923.59	2,404,923.59
负债总计	-	-	-	-	-	13,676,715.69	13,676,715.69
利率敏感度缺口	434,940,959.19	49,835,000.00	-	-	2,640,744.64	1,301,822,040.07	1,789,238,743.90
上年度末 2008 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	287,835,143.08	-	-	-	-	-	287,835,143.08
结算备付金	13,131,768.76	-	-	-	-	-	13,131,768.76
存出保证	-	-	-	-	-	1,863,556.18	1,863,556.18

金							
交易性金融资产	115,584,000.00	96,770,000.00	87,770,000.00	-	-	1,036,793,897.05	1,336,917,897.05
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	9,174,079.60	9,174,079.60
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	120,176,974.16	-	-	-	-	-	120,176,974.16
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	536,727,886.00	96,770,000.00	87,770,000.00	-	-	1,047,831,532.83	1,769,099,418.83
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	56,597,791.91	56,597,791.91
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,018,047.71	1,018,047.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,042,944.94	2,042,944.94
应付托管费	-	-	-	-	-	340,490.84	340,490.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,480,528.28	7,480,528.28
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,245,998.51	2,245,998.51
负债总计	-	-	-	-	-	69,725,802.19	69,725,802.19
利率敏感度缺口	536,727,886.00	96,770,000.00	87,770,000.00	-	-	978,105,730.64	1,699,373,616.64

注：本基金的各项按金融资产或金融负债的剩余期限为标准予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。	
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。	
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	增加 61,749.60	增加 187,816.95
	利率上升 25 个基点	减少 60,254.40	减少 186,510.31

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。

本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

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%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,301,773,477.64	72.76	1,036,793,897.05	61.01
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,301,773,477.64	72.76	1,036,793,897.05	61.01

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）			
	相关风险变量的变动	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日	
分析	1、本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准			
	2、选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数			
	业绩基准下跌 1%	减少 18,250,235.19	减少 11,215,865.87	
	业绩基准下跌 5%	减少 91,251,175.94	减少 56,079,329.35	
	业绩基准下跌 10%	减少 182,502,351.88	减少 112,158,658.70	

注：报告期内，本基金 beta 值为 1.02，2008 年为 0.66，在市场上升期，较高 Beta 系数会使得基金组合获得高于基金基准的收益。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

§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	1,301,773,477.64	72.20
	其中：股票	1,301,773,477.64	72.20
2	固定收益投资	52,475,744.64	2.91
	其中：债券	52,475,744.64	2.91
	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	434,759,440.28	24.11
6	其他各项资产	13,906,797.03	0.77
7	合计	1,802,915,459.59	100.00

8.2 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	-	-
B	采掘业	20,698,074.79	1.16
C	制造业	1,043,031,077.57	58.29
C0	食品、饮料	288,156,102.95	16.10
C1	纺织、服装、皮毛	3,420,800.00	0.19
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	966,732.48	0.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	167,352,214.04	9.35
C5	电子	94,857,107.96	5.30
C6	金属、非金属	165,415,973.59	9.25
C7	机械、设备、仪表	212,236,711.83	11.86
C8	医药、生物制品	110,625,434.72	6.18

C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	76,020.00	0.00
F	交通运输、仓储业	15,755,581.86	0.88
G	信息技术业	57,885,929.19	3.24
H	批发和零售贸易	95,973,418.89	5.36
I	金融、保险业	44,137,000.00	2.47
J	房地产业	7,113,346.54	0.40
K	社会服务业	12,861,028.80	0.72
L	传播与文化产业	4,242,000.00	0.24
M	综合类	-	-
	合计	1,301,773,477.64	72.76

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000596	古井贡酒	3,992,318	135,698,888.82	7.58
2	000792	盐湖钾肥	1,893,871	107,931,708.29	6.03
3	600060	海信电器	3,251,324	83,851,645.96	4.69
4	002038	双鹭药业	1,854,177	82,325,458.80	4.60
5	600600	青岛啤酒	1,374,295	51,687,234.95	2.89
6	600315	上海家化	1,559,835	51,318,571.50	2.87
7	600690	青岛海尔	1,971,016	48,861,486.64	2.73
8	000568	泸州老窖	1,199,977	46,847,102.08	2.62
9	600837	海通证券	2,300,000	44,137,000.00	2.47
10	000418	小天鹅 A	2,862,430	41,877,350.90	2.34
11	000016	深康佳 A	5,440,700	41,838,983.00	2.34
12	600425	青松建化	1,589,522	35,859,616.32	2.00
13	000969	安泰科技	1,307,781	34,682,352.12	1.94
14	002262	恩华药业	1,561,015	29,253,421.10	1.64
15	600581	八一钢铁	1,549,888	24,798,208.00	1.39
16	000959	首钢股份	3,986,246	23,957,338.46	1.34
17	600570	恒生电子	1,059,093	22,251,543.93	1.24
18	000028	一致药业	799,951	22,142,643.68	1.24
19	000895	双汇发展	412,091	21,882,032.10	1.22
20	000759	武汉中百	1,500,000	19,725,000.00	1.10
21	600102	莱钢股份	1,340,219	17,516,662.33	0.98
22	600587	新华医疗	1,070,510	17,374,377.30	0.97
23	000876	新希望	1,200,000	16,536,000.00	0.92
24	000527	美的电器	695,100	16,126,320.00	0.90

25	600029	南方航空	2,599,931	15,755,581.86	0.88
26	002063	远光软件	691,373	15,742,563.21	0.88
27	000848	承德露露	587,750	15,504,845.00	0.87
28	002024	苏宁电器	700,000	14,546,000.00	0.81
29	600983	合肥三洋	527,504	13,298,375.84	0.74
30	000521	美菱电器	928,106	12,186,031.78	0.68
31	600869	三普药业	660,652	11,667,114.32	0.65
32	000651	格力电器	400,000	11,576,000.00	0.65
33	002080	中材科技	287,870	10,334,533.00	0.58
34	600739	辽宁成大	270,579	10,306,354.11	0.58
35	000999	三九医药	500,000	9,980,000.00	0.56
36	601888	中国国旅	444,000	9,297,360.00	0.52
37	000877	天山股份	390,400	8,288,192.00	0.46
38	002138	顺络电子	400,000	8,092,000.00	0.45
39	600583	海油工程	655,739	7,475,424.60	0.42
40	002153	石基信息	225,998	7,453,414.04	0.42
41	000983	西山煤电	180,609	7,204,493.01	0.40
42	002146	荣盛发展	343,474	7,113,346.54	0.40
43	000039	中集集团	500,000	6,550,000.00	0.37
44	600089	特变电工	242,100	5,761,980.00	0.32
45	600557	康缘药业	269,234	5,640,452.30	0.32
46	002095	生意宝	140,292	5,186,595.24	0.29
47	002065	东华软件	199,820	4,643,816.80	0.26
48	600409	三友化工	500,000	4,310,000.00	0.24
49	002238	天威视讯	200,000	4,242,000.00	0.24
50	002254	烟台氨纶	105,559	3,773,734.25	0.21
51	300015	爱尔眼科	73,026	3,563,668.80	0.20
52	000708	大冶特钢	281,996	3,429,071.36	0.19
53	002003	伟星股份	160,000	3,420,800.00	0.19
54	601699	潞安环能	65,601	3,396,819.78	0.19
55	002214	大立科技	97,800	2,913,462.00	0.16
56	002148	北纬通信	65,760	2,268,720.00	0.13
57	000939	凯迪电力	112,100	1,994,259.00	0.11
58	600499	科达机电	88,539	1,932,806.37	0.11
59	000625	长安汽车	100,000	1,403,000.00	0.08
60	002294	信立泰	11,410	1,012,409.30	0.06
61	002292	奥飞动漫	22,752	966,732.48	0.05
62	000937	金牛能源	15,074	627,078.40	0.04
63	002308	威创股份	10,659	339,275.97	0.02
64	601117	中国化学	14,000	76,020.00	0.00
65	300041	回天胶业	500	18,200.00	0.00

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

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	646,544,163.00	38.05
2	601318	中国平安	607,100,945.88	35.72
3	000002	万科 A	509,625,875.60	29.99
4	601088	中国神华	459,875,082.62	27.06
5	600837	海通证券	399,634,353.03	23.52
6	601166	兴业银行	382,874,990.50	22.53
7	000983	西山煤电	373,483,121.29	21.98
8	000878	云南铜业	321,106,275.97	18.90
9	600000	浦发银行	313,042,107.20	18.42
10	601601	中国太保	304,761,994.82	17.93
11	600362	江西铜业	283,472,151.84	16.68
12	000937	金牛能源	267,071,424.15	15.72
13	600036	招商银行	255,041,170.08	15.01
14	000001	深发展 A	242,068,862.56	14.24
15	601899	紫金矿业	205,964,630.46	12.12
16	601628	中国人寿	203,334,820.80	11.97
17	600050	中国联通	197,263,412.40	11.61
18	601600	中国铝业	193,047,096.76	11.36
19	000024	招商地产	190,899,899.36	11.23
20	600528	中铁二局	188,660,664.46	11.10
21	000933	神火股份	188,404,073.55	11.09
22	601168	西部矿业	187,137,264.16	11.01
23	600089	特变电工	184,269,983.07	10.84
24	601666	平煤股份	180,250,904.24	10.61
25	600600	青岛啤酒	172,868,938.91	10.17
26	601958	金钼股份	165,592,860.68	9.74
27	600383	金地集团	163,579,981.19	9.63
28	600276	恒瑞医药	162,958,721.47	9.59
29	600031	三一重工	161,589,076.64	9.51
30	601699	潞安环能	159,751,675.27	9.40
31	601898	中煤能源	157,938,046.14	9.29
32	600048	保利地产	156,791,657.93	9.23
33	000623	吉林敖东	156,752,854.29	9.22
34	600348	国阳新能	156,205,460.60	9.19
35	601398	工商银行	153,270,139.25	9.02

36	600188	兖州煤业	146,261,741.16	8.61
37	600395	盘江股份	141,848,732.52	8.35
38	600432	吉恩镍业	140,997,190.50	8.30
39	000630	铜陵有色	137,610,195.19	8.10
40	600016	民生银行	134,604,367.19	7.92
41	600997	开滦股份	132,396,246.07	7.79
42	000858	五粮液	130,380,572.06	7.67
43	601328	交通银行	127,150,489.83	7.48
44	600019	宝钢股份	123,693,395.61	7.28
45	000407	胜利股份	122,692,834.71	7.22
46	600239	云南城投	120,437,289.15	7.09
47	000060	中金岭南	118,398,996.36	6.97
48	600739	辽宁成大	116,061,553.93	6.83
49	000792	盐湖钾肥	110,859,100.63	6.52
50	600675	中华企业	109,020,668.95	6.42
51	000679	大连友谊	109,012,774.46	6.41
52	600550	天威保变	103,414,579.02	6.09
53	000157	中联重科	102,722,429.72	6.04
54	000568	泸州老窖	101,279,816.65	5.96
55	000400	许继电气	98,647,569.23	5.80
56	000069	华侨城 A	96,899,678.09	5.70
57	600123	兰花科创	96,667,764.84	5.69
58	000718	苏宁环球	90,942,059.54	5.35
59	600586	金晶科技	90,888,985.90	5.35
60	600900	长江电力	90,823,966.08	5.34
61	000596	古井贡酒	86,004,468.17	5.06
62	002038	双鹭药业	83,844,264.30	4.93
63	601001	大同煤业	83,478,669.06	4.91
64	600392	太工天成	80,818,688.87	4.76
65	600880	博瑞传播	79,136,718.07	4.66
66	600549	厦门钨业	78,871,677.06	4.64
67	000402	金融街	77,625,930.12	4.57
68	601169	北京银行	77,388,336.62	4.55
69	000969	安泰科技	76,901,834.91	4.53
70	000651	格力电器	75,820,947.66	4.46
71	601919	中国远洋	75,157,016.50	4.42
72	000527	美的电器	74,940,260.33	4.41
73	600546	山煤国际	73,363,310.78	4.32
74	600060	海信电器	73,328,095.71	4.32
75	000009	中国宝安	73,185,425.86	4.31
76	000012	南玻 A	72,423,489.67	4.26

77	000031	中粮地产	70,386,366.11	4.14
78	601186	中国铁建	68,737,620.11	4.04
79	600547	山东黄金	67,682,951.94	3.98
80	600151	航天机电	66,923,759.08	3.94
81	600585	海螺水泥	66,603,741.74	3.92
82	002238	天威视讯	63,492,543.74	3.74
83	600143	金发科技	61,729,156.38	3.63
84	000800	一汽轿车	61,542,979.58	3.62
85	600331	宏达股份	60,824,120.97	3.58
86	600863	内蒙华电	60,594,712.06	3.57
87	600598	北大荒	60,323,196.72	3.55
88	000951	中国重汽	60,263,639.64	3.55
89	600867	通化东宝	60,087,844.63	3.54
90	002015	霞客环保	59,287,429.45	3.49
91	600268	国电南自	59,063,735.62	3.48
92	600475	华光股份	59,053,815.23	3.48
93	000538	云南白药	58,815,553.74	3.46
94	000652	泰达股份	58,713,558.59	3.46
95	600170	上海建工	58,107,464.10	3.42
96	600309	烟台万华	58,037,330.49	3.42
97	000338	潍柴动力	56,797,020.35	3.34
98	000401	冀东水泥	56,561,400.94	3.33
99	002146	荣盛发展	56,492,026.20	3.32
100	601668	中国建筑	56,267,793.40	3.31
101	000826	合加资源	54,958,320.15	3.23
102	600690	青岛海尔	53,554,792.84	3.15
103	600517	置信电气	53,447,919.70	3.15
104	600635	大众公用	53,249,211.10	3.13
105	000063	中兴通讯	53,097,441.63	3.12
106	000686	东北证券	52,823,963.63	3.11
107	600005	武钢股份	52,553,864.95	3.09
108	601988	中国银行	52,119,733.00	3.07
109	600663	陆家嘴	50,554,032.03	2.97
110	601939	建设银行	50,542,277.58	2.97
111	600029	南方航空	50,512,825.83	2.97
112	600066	宇通客车	50,219,151.65	2.96
113	600581	八一钢铁	49,947,569.33	2.94
114	000728	国元证券	49,592,020.78	2.92
115	000839	中信国安	49,125,712.11	2.89
116	600694	大商股份	49,063,441.19	2.89
117	600320	振华重工	48,185,694.80	2.84

118	600639	浦东金桥	48,185,096.18	2.84
119	600221	海南航空	48,178,672.22	2.84
120	600161	天坛生物	48,018,124.03	2.83
121	002262	恩华药业	47,764,828.69	2.81
122	000758	中色股份	47,568,563.66	2.80
123	600018	上港集团	47,407,735.27	2.79
124	000059	辽通化工	46,959,938.53	2.76
125	600321	国栋建设	46,900,531.64	2.76
126	600236	桂冠电力	46,744,585.75	2.75
127	000960	锡业股份	46,408,060.33	2.73
128	000501	鄂武商 A	46,308,917.62	2.73
129	600315	上海家化	46,169,225.48	2.72
130	600185	*ST 海星	45,989,288.17	2.71
131	600166	福田汽车	45,741,282.99	2.69
132	600011	华能国际	45,318,841.48	2.67
133	000911	南宁糖业	45,091,714.52	2.65
134	600346	大橡塑	44,732,340.36	2.63
135	000625	长安汽车	44,554,269.55	2.62
136	600102	莱钢股份	42,930,001.72	2.53
137	600120	浙江东方	42,790,812.10	2.52
138	601006	大秦铁路	42,062,100.97	2.48
139	600803	威远生化	41,481,496.25	2.44
140	000016	深康佳 A	41,311,677.74	2.43
141	600009	上海机场	40,846,365.58	2.40
142	600582	天地科技	40,796,677.84	2.40
143	600104	上海汽车	40,768,724.90	2.40
144	000028	一致药业	40,275,117.15	2.37
145	600683	京投银泰	40,066,222.71	2.36
146	600875	东方电气	39,313,378.69	2.31
147	000876	新希望	39,187,621.10	2.31
148	600039	四川路桥	39,128,142.82	2.30
149	000948	南天信息	38,504,290.93	2.27
150	002267	陕天然气	38,167,437.37	2.25
151	002266	浙富股份	37,859,300.48	2.23
152	600895	张江高科	37,851,490.17	2.23
153	000759	武汉中百	37,438,566.13	2.20
154	600266	北京城建	37,162,244.39	2.19
155	601872	招商轮船	37,078,462.89	2.18
156	000418	小天鹅 A	36,459,704.11	2.15
157	002129	中环股份	36,430,003.33	2.14
158	600649	城投控股	36,021,629.37	2.12

159	000690	宝新能源	35,752,112.75	2.10
160	600059	古越龙山	34,444,246.17	2.03
161	000898	鞍钢股份	34,360,438.51	2.02
162	600804	鹏博士	34,193,347.67	2.01
163	600522	中天科技	34,116,886.03	2.01

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

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	600030	中信证券	656,963,434.63	38.66
2	601318	中国平安	645,229,650.05	37.97
3	000002	万科 A	514,421,977.85	30.27
4	601088	中国神华	455,628,833.48	26.81
5	000983	西山煤电	386,381,759.47	22.74
6	601166	兴业银行	386,176,859.67	22.72
7	600837	海通证券	362,196,905.71	21.31
8	000878	云南铜业	339,139,525.84	19.96
9	600000	浦发银行	323,014,250.59	19.01
10	601601	中国太保	319,158,107.56	18.78
11	600362	江西铜业	285,393,016.59	16.79
12	000937	金牛能源	271,310,465.38	15.97
13	600036	招商银行	267,228,893.40	15.73
14	600276	恒瑞医药	250,376,725.03	14.73
15	000001	深发展 A	244,737,997.76	14.40
16	600600	青岛啤酒	212,639,479.87	12.51
17	601628	中国人寿	206,364,702.82	12.14
18	601899	紫金矿业	205,661,370.07	12.10
19	601600	中国铝业	199,770,444.01	11.76
20	600528	中铁二局	193,681,738.16	11.40
21	600050	中国联通	192,341,926.32	11.32
22	601168	西部矿业	191,583,328.87	11.27
23	000933	神火股份	187,803,748.89	11.05
24	601699	潞安环能	179,560,459.98	10.57
25	600089	特变电工	179,392,563.57	10.56
26	601398	工商银行	179,199,506.05	10.55
27	000024	招商地产	178,809,264.59	10.52
28	601666	平煤股份	173,564,809.97	10.21
29	601958	金钼股份	170,559,342.00	10.04

30	600048	保利地产	164,872,481.45	9.70
31	600383	金地集团	163,376,906.17	9.61
32	600348	国阳新能	161,346,429.08	9.49
33	600031	三一重工	160,572,667.69	9.45
34	600997	开滦股份	158,972,590.67	9.35
35	000623	吉林敖东	156,508,557.80	9.21
36	600432	吉恩镍业	156,430,528.93	9.21
37	601898	中煤能源	150,316,241.64	8.85
38	000630	铜陵有色	144,203,831.01	8.49
39	000407	胜利股份	140,920,409.63	8.29
40	601328	交通银行	140,184,391.06	8.25
41	600188	兖州煤业	139,212,331.40	8.19
42	600395	盘江股份	137,405,919.54	8.09
43	600016	民生银行	129,386,051.67	7.61
44	002223	鱼跃医疗	128,018,578.44	7.53
45	600019	宝钢股份	125,530,110.39	7.39
46	000060	中金岭南	120,119,295.05	7.07
47	000858	五粮液	117,860,740.18	6.94
48	601186	中国铁建	117,685,686.09	6.93
49	000679	大连友谊	112,744,932.07	6.63
50	000157	中联重科	112,233,910.98	6.60
51	600123	兰花科创	107,449,499.72	6.32
52	600239	云南城投	105,476,457.82	6.21
53	002238	天威视讯	105,415,999.48	6.20
54	000538	云南白药	105,239,110.92	6.19
55	600550	天威保变	104,958,707.23	6.18
56	600880	博瑞传播	102,358,753.08	6.02
57	600739	辽宁成大	102,285,012.79	6.02
58	000400	许继电气	99,687,880.91	5.87
59	000069	华侨城 A	98,517,813.47	5.80
60	600675	中华企业	98,293,045.62	5.78
61	601001	大同煤业	94,022,131.15	5.53
62	600011	华能国际	92,416,576.88	5.44
63	600900	长江电力	92,247,617.00	5.43
64	600392	太工天成	91,239,247.98	5.37
65	000718	苏宁环球	90,642,942.87	5.33
66	600586	金晶科技	87,648,855.26	5.16
67	600549	厦门钨业	84,380,776.05	4.97
68	000012	南玻 A	81,114,633.23	4.77
69	601169	北京银行	80,065,557.44	4.71
70	600268	国电南自	76,322,860.95	4.49

71	002038	双鹭药业	74,959,005.95	4.41
72	600546	山煤国际	74,812,811.61	4.40
73	601919	中国远洋	72,827,100.18	4.29
74	600547	山东黄金	71,980,309.68	4.24
75	600585	海螺水泥	71,814,110.78	4.23
76	000009	中国宝安	70,331,206.11	4.14
77	600151	航天机电	68,410,684.02	4.03
78	600331	宏达股份	68,021,104.68	4.00
79	000031	中粮地产	66,920,776.87	3.94
80	002146	荣盛发展	66,013,031.80	3.88
81	600598	北大荒	65,673,671.51	3.86
82	000651	格力电器	65,559,460.94	3.86
83	000402	金融街	65,269,802.53	3.84
84	600170	上海建工	64,828,125.69	3.81
85	600161	天坛生物	63,302,663.95	3.73
86	000800	一汽轿车	62,316,879.98	3.67
87	000568	泸州老窖	61,781,717.10	3.64
88	000338	潍柴动力	61,620,126.73	3.63
89	000527	美的电器	59,263,004.09	3.49
90	002015	霞客环保	58,745,382.26	3.46
91	000652	泰达股份	58,249,026.75	3.43
92	600236	桂冠电力	57,811,248.46	3.40
93	000063	中兴通讯	57,737,424.40	3.40
94	000401	冀东水泥	56,324,059.93	3.31
95	600863	内蒙华电	56,192,141.57	3.31
96	600867	通化东宝	55,738,080.69	3.28
97	600143	金发科技	55,612,471.89	3.27
98	601668	中国建筑	55,366,023.70	3.26
99	600475	华光股份	54,804,806.23	3.23
100	600694	大商股份	53,119,896.67	3.13
101	600635	大众公用	53,005,721.28	3.12
102	601939	建设银行	52,950,000.00	3.12
103	000951	中国重汽	52,675,006.36	3.10
104	600018	上港集团	52,229,474.24	3.07
105	601988	中国银行	51,978,386.00	3.06
106	000960	锡业股份	51,955,000.27	3.06
107	000911	南宁糖业	51,760,462.37	3.05
108	600309	烟台万华	51,598,752.86	3.04
109	600005	武钢股份	51,055,428.45	3.00
110	600639	浦东金桥	50,857,272.20	2.99
111	600663	陆家嘴	50,802,287.21	2.99

112	000758	中色股份	50,477,496.10	2.97
113	600027	华电国际	50,352,275.58	2.96
114	000826	合加资源	49,674,357.61	2.92
115	600664	哈药股份	49,227,181.22	2.90
116	601766	中国南车	48,930,292.27	2.88
117	600221	海南航空	48,827,796.60	2.87
118	000728	国元证券	48,788,016.78	2.87
119	600009	上海机场	48,497,930.35	2.85
120	000839	中信国安	48,301,977.71	2.84
121	000686	东北证券	48,249,339.17	2.84
122	000690	宝新能源	48,154,104.53	2.83
123	601390	中国中铁	48,032,826.04	2.83
124	600517	置信电气	47,397,759.76	2.79
125	600166	福田汽车	47,245,540.56	2.78
126	000625	长安汽车	47,184,062.62	2.78
127	000059	辽通化工	47,075,956.23	2.77
128	600185	*ST 海星	46,956,801.55	2.76
129	000501	鄂武商 A	46,705,270.15	2.75
130	000969	安泰科技	45,917,506.98	2.70
131	600066	宇通客车	45,061,338.49	2.65
132	600312	平高电气	44,620,274.69	2.63
133	600320	振华重工	44,461,003.66	2.62
134	600380	健康元	43,984,801.98	2.59
135	600321	国栋建设	43,770,408.45	2.58
136	600803	威远生化	42,732,540.82	2.51
137	600582	天地科技	42,697,990.29	2.51
138	600795	国电电力	42,253,846.41	2.49
139	601872	招商轮船	41,842,055.97	2.46
140	600104	上海汽车	41,832,227.86	2.46
141	600346	大橡塑	41,708,205.89	2.45
142	600804	鹏博士	41,555,359.72	2.45
143	600683	京投银泰	41,250,267.68	2.43
144	600039	四川路桥	40,490,444.99	2.38
145	600029	南方航空	40,149,877.00	2.36
146	600266	北京城建	39,957,211.19	2.35
147	600522	中天科技	39,864,999.79	2.35
148	600649	城投控股	39,679,198.54	2.33
149	600396	金山股份	39,539,760.07	2.33
150	000898	鞍钢股份	39,284,744.01	2.31
151	601006	大秦铁路	39,050,417.04	2.30
152	600875	东方电气	38,834,482.10	2.29

153	600741	华域汽车	38,007,421.41	2.24
154	002266	浙富股份	37,684,178.90	2.22
155	600895	张江高科	36,909,045.08	2.17
156	000948	南天信息	36,605,694.00	2.15
157	600120	浙江东方	36,528,239.99	2.15
158	002267	陕天然气	35,831,882.71	2.11
159	600405	动力源	35,378,455.21	2.08
160	600489	中金黄金	34,825,699.97	2.05
161	600316	洪都航空	34,729,566.23	2.04
162	600068	葛洲坝	34,559,876.37	2.03
163	600059	古越龙山	34,077,104.26	2.01

注：本项的“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	20,186,717,580.84
卖出股票的收入（成交）总额	20,496,803,739.55

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	-	-
2	央行票据	49,835,000.00	2.79
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	2,640,744.64	0.15
7	其他	-	-
8	合计	52,475,744.64	2.93

8.6 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	0901065	09 央票 65	500,000	49,835,000.00	2.79
2	125969	安泰转债	17,632	2,640,744.64	0.15

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券除盐湖钾肥外，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。

盐湖钾肥于 2009 年 2 月 26 日发布了“青海盐湖钾肥股份有限公司受到有关部门相关处罚的提示性公告”，本基金投资该股票，主要是考虑到其作为深市老牌绩优股，业绩长期保持优良，投资流程符合公司投资管理制度和证监会的相关规定，其受到的处罚情况，我们认为不影响其长期投资价值，对该公司业绩影响较小。

8.9.2 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。

8.9.3 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	5,333,360.31
2	应收证券清算款	8,265,257.49
3	应收股利	-
4	应收利息	126,660.32
5	应收申购款	181,518.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,906,797.03

8.9.4 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。

8.9.5 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。

8.9.6 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
85,295	17,401.32	190,656,943.74	12.85%	1,293,588,552.75	87.15%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年12月15日)基金份额总额	2,144,214,669.67
本报告期期初基金份额总额	1,877,816,477.29
本报告期期间基金总申购份额	402,664,390.05
减：本报告期期间基金总赎回份额	796,235,370.85
本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	1,484,245,496.49

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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

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江苏公证天业会计师事务所，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，本报告期内支付审计费 90000 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

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。

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	8,829,847,710.36	21.71%	7,471,753.19	21.92%	-
国信证券	1	1,874,694,183.20	4.61%	1,593,472.30	4.68%	-
中信证券	1	3,221,747,348.96	7.92%	2,617,696.39	7.68%	-
招商证券	1	1,937,503,321.02	4.76%	1,574,246.15	4.62%	-
东方证券	1	2,485,144,169.80	6.11%	2,019,207.70	5.92%	-
银河证券	1	759,327,599.29	1.87%	616,961.55	1.81%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	1,537,490,737.66	3.78%	1,249,224.70	3.67%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	1,987,091,886.01	4.88%	1,689,015.25	4.96%	-
中信建投	1	440,936,051.84	1.08%	374,793.91	1.10%	-
中金公司	1	6,096,380,697.71	14.99%	5,181,891.31	15.20%	-
国元证券	1	642,773,681.11	1.58%	546,359.99	1.60%	-
申银万国	1	2,122,037,462.38	5.22%	1,803,723.23	5.29%	-
国金证券	1	1,588,644,304.53	3.91%	1,350,349.50	3.96%	-
江南证券	1	1,470,913,424.39	3.62%	1,195,131.88	3.51%	-
齐鲁证券	1	780,784,820.37	1.92%	663,659.69	1.95%	-
中投证券	1	926,975,933.70	2.28%	753,178.19	2.21%	-
东海证券	1	878,178,821.98	2.16%	746,448.54	2.19%	-
安信证券	1	659,310,882.30	1.62%	560,411.01	1.64%	-
大通证券	1	641,999,937.53	1.58%	545,699.56	1.60%	-
平安证券	1	1,798,077,591.57	4.42%	1,528,366.14	4.48%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
合计	25	40,679,860,565.71	100.00%	34,081,590.18	100.00%	-

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

本报告期本基金新增交易单元 7 个，分别为：中投证券、安信证券、东海证券、大通证券、平安证券、华宝证券、爱建证券交易单元。

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		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 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	-	-	-	-	-	-
国信证券	1,311,555.00	3.10%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国金证券	7,909,922.00	18.68%	-	-	-	-
江南证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	13,086,782.38	30.91%	-	-	-	-
平安证券	20,034,692.96	47.32%	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
合计	42,342,952.34	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《东吴基金管理有限公司关于恢复旗下基金产品持有的盐湖钾肥股票市价估值方法》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-01-06
2	《东吴基金管理有限公司关于增加旗下股票型证券投资基金基金经理》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-01-20
3	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金 2008 年第 4 季度报告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-01-21
4	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金更新招募说明书摘要》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-01-23
5	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增	证券时报、中国证券	2009-02-06

	加深圳平安银行为代销机构并开通定期定额业务》	报、上海证券报	
6	《东吴基金管理有限公司提请投资者更新已过期身份证件通知》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-02-12
7	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在宁波银行股份有限公司推出定期定额投资业务》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-02-18
8	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行网上银行基金申购费率优惠调整》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-02-25
9	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司基智定投营销活动》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-02-26
10	《东吴基金管理有限公司关于开通旗下基金的基金转换业务》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-02-26
11	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在华夏银行股份有限公司推出定期定额申购费率优惠》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-02-27
12	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加东海证券有限责任公司为代销机构》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-03-05
13	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加中国建银投资证券有限责任公司为代销机构》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-03-24
14	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中国工商银行网上银行申购费率优惠》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-03-31
15	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金 2008 年年度报告摘要》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-03-31
16	《东吴行业轮动股票型证券投资基金 2008 年年度报告摘要》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-03-31
17	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中国建设银行股份有限公司实行电话银行基金申购费率优惠》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-04-09
18	《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行为代销机构并推出定期定额业务及转换业务》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-04-15
19	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加爱建证券有限责任公司为代销机构》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-04-20
20	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金 2009 年第 1 季度报告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-04-20
21	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在联合证券有限责任公司推出定期定额申购费率优惠活动》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-05-04
22	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券有限责任公司为代销机构》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-06-16

23	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加华宝证券经纪有限责任公司为代销机构并开通定期定额业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-06-19
24	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金 2009 年第 2 季度报告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-07-21
25	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金更新招募说明书摘要》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-08-04
26	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加长江证券股份有限公司为代销机构并推出定期定额投资业务及转换业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-08-13
27	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加天相投资顾问有限公司为代销机构并开通转换业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-08-19
28	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金 2009 年上半年报告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-08-27
29	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在齐鲁证券有限公司网上交易系统申购费率优惠的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-09-09
30	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金投资创业板证券的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-09-22
31	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增广发华福证券有限责任公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务同时参与网上交易申购费率优惠的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-09-22
32	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在湘财证券有限责任公司推出定期定额投资业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-10-22
33	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加宏源证券股份有限公司为代销机构并开通转换业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-10-22
34	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金三季度报告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-10-28
35	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加信达证券股份有限公司为代销机构并开通转换业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-11-04
36	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在国信证券股份有限公司推出定期定额投资业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-11-18
37	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加华安证券有限责任公司为代销机构并推出定期定额投资业务及转换业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-11-24
38	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中国建银投资证券有限责任公司网上交易	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-12-01

	系统申购费率优惠的公告》		
39	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国建设银行网上银行等电子渠道基金申购费率优惠活动的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-12-07
40	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投证券有限责任公司延长基金定投申购优惠活动的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-12-21
41	《东吴基金管理有限公司关于在华夏银行股份有限公司开通基金转换业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-12-28
42	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司推出的“2010倾心回馈”定期定额申购费率优惠活动的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-12-30
43	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在爱建证券有限责任公司推出定期定额投资业务的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-12-30
44	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-12-31
45	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司推出的定期定额申购费率优惠活动的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-12-31
46	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行有限责任公司网上银行基金申购费率优惠的公告》	证券时报、中国证券报、上海证券报	2009-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴价值成长双动力股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内东吴价值成长双动力股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话（021）50509666

东吴基金管理有限公司
二〇一〇年三月二十七日