

# 东吴价值成长双动力股票型证券投资基金

## 2011 年半年度报告

### 2011 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：二〇一一年八月二十七日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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。

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 2011 年 8 月 24 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 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.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	37
7.7 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.....	37
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.....	37
7.9 投资组合报告附注.....	37

8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
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.....	38
9 开放式基金份额变动.....	38
10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	42
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	43
12 备查文件目录.....	43
12.1 备查文件目录.....	43
12.2 存放地点.....	43
12.3 查阅方式.....	43

## 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	581002
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	2,193,171,513.13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	010-63201510
	电子邮箱	huangzhp@scfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		021-50509666 / 400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-63201816
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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200135	100031
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路 279 号

## 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	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-78,886,151.15
本期利润	-416,025,095.62
加权平均基金份额本期利润	-0.1739
本期加权平均净值利润率	-13.14%

本期基金份额净值增长率	-12.16%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2011年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-8,367,912.97
期末可供分配基金份额利润	-0.0038
期末基金资产净值	2,736,587,241.94
期末基金份额净值	1.2478
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2011年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	82.61%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	2.24%	1.00%	1.30%	0.93%	0.94%	0.07%
过去三个月	-3.74%	0.92%	-4.60%	0.85%	0.86%	0.07%
过去六个月	-12.16%	1.04%	-3.03%	0.93%	-9.13%	0.11%
过去一年	10.75%	1.32%	15.09%	1.05%	-4.34%	0.27%
过去三年	5.54%	1.54%	13.55%	1.50%	-8.01%	0.04%
自基金合同生效起至今	82.61%	1.70%	56.54%	1.67%	26.07%	0.03%

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

份额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2011年6月30日)



注：1、东吴价值成长双动力基金于 2006 年 12 月 15 日成立。  
2、比较基准=75%\*新华富时 A600 指数+25%\*中信标普全债指数。

## 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，由东吴证券股份有限公司、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。

作为传统吴文化与前沿经济理念的有机结合，东吴基金崇尚“以人为本，以市场为导向，以客户为中心，以价值创造为根本出发点”的经营理念；遵循“诚而有信、稳而又健、和而有争、勤而又专、有容乃大”的企业格言；树立了“做价值的创造者、市场的创新者和行业的思想者”的远大理想，创造性地树立自己独特的文化体系，在众多基金管理公司中树立自己鲜明的企业形象。

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共管理基金 9 只，其中混合型基金 2 只，分别为东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金；股票型基金 4 只，分别为东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、东吴行业轮动股票型证券投资基金、东吴新经济股票型证券投资基金、东吴创业板股票型证券投资基

金；债券型基金 1 只，为东吴优信稳健债券型证券投资基金；货币型基金 1 只，为东吴货币市场证券投资基金；指数型基金 1 只，为东吴中证新兴产业指数证券投资基金。

#### 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（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
王炯	本基金的基金经理、公司总裁助理、投资总监、投资管理部总经理	2006-12-15	2011-05-14	14 年	硕士，武汉大学毕业，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；2004 年 4 月加入东吴基金管理有限公司，历任基金经理助理、投资管理部副总经理、投资副总监等职务，现担任公司投资总监、投资管理部总经理。
王少成	本基金的基金经理	2011-05-14	-	8 年	硕士，复旦大学毕业。曾任上海融昌资产管理公司研究员、中原证券自营部投资经理、信诚基金管理有限公司研究员、研究总监助理等职；2009 年 6 月加入东吴基金管理有限公司，现担任东吴双动力基金经理、东吴新创业基金经理、东吴中证新兴产业指数基金经理。

注：1、王炯女士为该基金的首任基金经理，自 5 月 14 日起不再担任本基金基金经理。此处的任职日期为基金成立日，其它日期均为公司作出决定之日。

2、王少成先生为本基金本报告期新聘任的基金经理，本次基金经理变更事项已于 2011 年 5 月 16 日登载于相关媒体。

3、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遵规守信情况的说明

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

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，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，确保了公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

#### 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-12.16%，东吴行业轮动股票型证券投资基金为-6.19%。

#### 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

上半年国内宏观经济仍未着陆。宏观数据之间打架，作为经济的领先指标的 PMI（汇丰）已经创 28 个月的新低，而作为经济同步指标的工业增加值数据在 6 月份出现反弹。由于货币政策收紧始终偏重数量化的手段，使得上半年国内宏观经济景气回落有限，但呈现严重的结构性分化。经济中承载就业压力最大的中小企业经营艰难，而地方政府支持高强度固定资产投资驱动宏观经济依然处于景气区间。

上半年 A 股市场呈现明显的低估值风格。上半年由于国内的宏观经济依然处于景气的高位，以社会融资总量指标观察的整体流动性依然充裕，从而驱动 A 股低估值板块产生了明显的超额收益。比较而言，消费类和新兴产业相关板块和个股经历了明显的估值压缩，这种情况在下半年有望得到扭转。

上半年的操作的回顾。上半年东吴价值成长双动力基金整体上保持在中性的仓位水平，一方面坚守了大消费板块中优势个股的配置，另一方面增加了低估值和通胀受益板块的配置。

#### 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 1.2478 元，累计净值 1.8278 元；本报告期份额净值增长率-12.16%，同期业绩比较基准收益率为-3.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球主权债务危机进入观察期。回顾历史，二十世纪初作为国际货币机制的金本位被放弃后，曾引起了全球经济长期的低迷和混乱。在之后的牙买加体系下，黄金作为储备资产的作用大大削减，各国货币价值也基本上与黄金脱钩。美国次贷危机后，以美元为锚的国际货币机制越来越受到质疑，受此影响主要国家间的汇率波动明显加大。一旦主权债务风险失控将引发国际金融市场的剧烈震荡，加大全球经济二次衰退的风险。

市场作为资源配置的方式是否会被削弱是一项不确定因素。过去 10 年是中国经济的黄金十年。出口部门的繁荣景气，一方面带动了持续产能投资，驱动了中国的重化工业蓬勃发展；另一方面，也是更为重要的，出口部门的繁荣使得市场机制在资源配置上的重要性逐步凸显。金融危机后，政府干预成为各国经济管理中日益突出的特点，其代价是债务风险从私人部门迅速转移至政府部门。对中国来说，我们看到政府对资本（信贷，直接融资），土地（房地产等）等要素市场的干预日渐加深，市场作为资源配置作用得到削弱。考虑到未来中国面临的结构转型的压力，如果削弱市场在资源配置上的作用，势必导致更大的扭曲，将极大的增加经济结构转型的成本。

政策方向的抉择决定中国经济的中期前景。中国当前的通胀压力依然较大，并有长期化趋势。我们认为，控制通胀必然以经济回落为前提，货币政策应该持续收紧，而紧缩政策应以价格措施为主。在当前复杂的情境下，控制通胀可能需要比以往更大的代价，这些代价包括，投资的硬着陆风险，短期结构性问题的加剧等。值得担心的是，若紧缩的货币政策出现松动，通胀失控而结构性问题遭到反复强化，中国经济陷入长期滞涨的风险将显著增加。

中国经济的出路在于结构调整。传统的增长模式难以为继，经济结构调整压力日渐增大。压力体现在两个方面，首先是利润率。通过政策指引和扶持，新的驱动产业如何实现高于传统行业的可持续的利润率，从而不断吸引投资形成正向良性的反馈机制。其次，技术和市场的突破。新的驱动产业的发展如何在技术和市场上实现突破，形成一个新的行业或将已有行业容量从小做大。所有的一切依赖市场化的资源配置辅以针对性的政策引导。

下半年看好大消费和新兴产业。从宏观背景到政策的变化，我们认为下半年大消费和新兴产业相关的板块和核心品种将产生超额收益。由于宏观经济未来可能还会有一个明显的回

落，而通胀的回落趋势也需要逐步确认，所以配置上个股机会将先于行业板块的机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总裁、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、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；运营总监、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、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。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，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，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定：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；基金当年收益先弥补以前年度亏损后，才可进行当年收益分配；全年合计的基金收益分配比例不低于本基金年度已实现净收益的 50%。

本基金于 2011 年 3 月 2 日对 2010 年收益进行了分配，每十份基金份额分红 0.60 元，合计分配利润为 150,766,823.12 元，其中现金形式发放 75,177,875.88 元，再投资形式发放 75,588,947.24 元。本报告期末，本基金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 2011 年 1 月 1 日至 2011 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投资运作遵规守信、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 托管人对本半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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

## 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 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:2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2011 年 6 月 30 日	2010 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	384,339,186.26	692,923,318.52
结算备付金		3,522,753.77	29,029,179.24
存出保证金		6,473,751.67	7,262,878.16
交易性金融资产	6.4.7.2	2,177,367,463.82	3,107,170,005.98
其中：股票投资		2,078,021,425.72	2,958,323,045.78
基金投资		-	-
债券投资		99,346,038.10	148,846,960.20
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	196,000,298.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	732,437.66	3,869,872.16
应收股利		-	-
应收申购款		713,208.58	9,968,711.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,769,149,099.76	3,850,223,965.84
<b>负债和所有者权益</b>		<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>附注号</b>	<b>2011 年 6 月 30 日</b>	<b>2010 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		15,278,413.94	80,965,170.24
应付赎回款		1,808,698.80	5,193,689.29
应付管理人报酬		3,306,876.73	4,786,329.50
应付托管费		551,146.12	797,721.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,416,701.74	11,814,245.75
应交税费		2,208.00	2,208.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,197,812.49	3,357,895.86
负债合计		32,561,857.82	106,917,260.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,193,171,513.13	2,524,442,353.47
未分配利润	6.4.7.10	543,415,728.81	1,218,864,352.16
所有者权益合计		2,736,587,241.94	3,743,306,705.63

负债和所有者权益总计		2,769,149,099.76	3,850,223,965.84
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2478 元，基金份额总额 2,193,171,513.13 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-370,054,472.73</b>	<b>-76,361,122.52</b>
1.利息收入		6,182,466.58	2,305,670.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,007,486.13	2,170,138.05
债券利息收入		1,948,818.45	135,532.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,226,162.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-40,397,965.21	4,209,781.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-50,438,959.61	-2,256,492.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-795,605.00	1,081,351.41
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	10,836,599.40	5,384,922.22
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-337,138,944.47	-83,084,747.92
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,299,970.37	208,173.58
<b>减：二、费用</b>		<b>45,970,622.89</b>	<b>32,716,825.48</b>
1.管理人报酬		23,654,205.36	15,230,971.83
2.托管费		3,942,367.55	2,538,495.28
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	18,166,323.30	14,743,393.82
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6.4.7.19	207,726.68	203,964.55
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-416,025,095.62</b>	<b>-109,077,948.00</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-416,025,095.62</b>	<b>-109,077,948.00</b>

### 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	2,524,442,353.47	1,218,864,352.16	3,743,306,705.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-416,025,095.62	-416,025,095.62
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)	-331,270,840.34	-108,656,704.61	-439,927,544.95
其中：1. 基金申购款	518,253,631.69	177,749,615.88	696,003,247.57
2. 基金赎回款	-849,524,472.03	-286,406,320.49	-1,135,930,792.52
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)	-	-150,766,823.12	-150,766,823.12
五、期末所有者权益(基金净值)	2,193,171,513.13	543,415,728.81	2,736,587,241.94
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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)	1,484,245,496.49	304,993,247.41	1,789,238,743.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-109,077,948.00	-109,077,948.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净	796,467,222.95	205,749,867.47	1,002,217,090.42

值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	983,315,059.88	248,284,604.39	1,231,599,664.27
2.基金赎回款	-186,847,836.93	-42,534,736.92	-229,382,573.85
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）	2,280,712,719.44	401,665,166.88	2,682,377,886.32

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 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人募集,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。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则——基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会于2010年2月8日发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金合同》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

### 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	384,339,186.26
定期存款	-
其他存款	-
合计	384,339,186.26

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,934,728,871.06	2,078,021,425.72	143,292,554.66	
债券	交易所市场	11,232,000.00	11,899,038.10	667,038.10
	银行间市场	87,576,640.00	87,447,000.00	-129,640.00
	合计	98,808,640.00	99,346,038.10	537,398.10
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,033,537,511.06	2,177,367,463.82	143,829,952.76	

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售金融资产	196,000,298.00	-
合计	196,000,298.00	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	75,536.83
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	1,426.68
应收债券利息	628,795.95
应收买入返售证券利息	26,551.32
应收申购款利息	126.88
其他	-
合计	732,437.66

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	8,413,781.26
银行间市场应付交易费用	2,920.48
合计	8,416,701.74

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	3,000,000.00

应付赎回费	3,079.84
应付后端申购费	1,335.96
债券利息税	-
预提费用	193,396.69
银行手续费	-
合计	3,197,812.49

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,524,442,353.47	2,524,442,353.47
本期申购	518,253,631.69	518,253,631.69
本期赎回（以“-”号填列）	-849,524,472.03	-849,524,472.03
本期末	2,193,171,513.13	2,193,171,513.13

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；  
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

#### 6.4.7.10 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	233,967,388.16	984,896,964.00	1,218,864,352.16
本期利润	-78,886,151.15	-337,138,944.47	-416,025,095.62
本期基金份额交易产生的变动数	-12,682,326.86	-95,974,377.75	-108,656,704.61
其中：基金申购款	27,757,082.19	149,992,533.69	177,749,615.88
基金赎回款	-40,439,409.05	-245,966,911.44	-286,406,320.49
本期已分配利润	-150,766,823.12	-	-150,766,823.12
本期末	-8,367,912.97	551,783,641.78	543,415,728.81

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	活期存款利息收入	1,881,723.00
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	98,626.77	
其他	27,136.36	
合计	2,007,486.13	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	6,172,755,765.67
减：卖出股票成本总额	6,223,194,725.28
买卖股票差价收入	-50,438,959.61

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	278,876,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	273,612,605.00
减：应收利息总额	6,059,000.00
债券投资收益	-795,605.00

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无权证交易。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,836,599.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,836,599.40

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-337,138,944.47
——股票投资	-337,578,867.37
——债券投资	439,922.90
——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	-337,138,944.47

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	802,812.88
转换费收入	497,157.49
合计	1,299,970.37

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	18,164,860.80
银行间市场交易费用	1,462.50
合计	18,166,323.30

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
帐户维护费	9,000.00
汇划费	5,179.99
其他费用	150.00
合计	207,726.68

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无需要说明的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无需要说明的日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 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**

本报告期基金关联方未发生变化。

**6.4.9.2 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
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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
东吴证券股份有限公司	2,916,411,036.78	24.66%	1,674,224,302.10	16.94%

## 6.4.10.1.2 权证交易

无。

## 6.4.10.1.3 债券交易

无。

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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
东吴证券股份有限公司	2,409,642.29	24.51%	68,480.32	0.81%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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
东吴证券股份有限公司	1,363,895.11	16.62%	603,915.40	11.45%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用，包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等。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。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,654,205.36	15,230,971.83
其中：支付销售机构的客户维护费	2,804,415.01	1,877,494.63

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 × 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,942,367.55	2,538,495.28

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 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

#### 6.4.10.3 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可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未持有本基金份额。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
东吴证券股份有限公司	13,456,469.01	0.61%	-	-

注：本关联方投资本基金的费率是公允的，均遵照本基金公告的费率执行。

#### 6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	384,339,186.26	1,881,723.00	1,066,324,169.87	2,056,332.48

**6.4.10.6 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可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.11 利润分配情况**

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	利润分配 合计	备注
1	2011-03-02	2011-03-02	0.600	75,177,875.88	75,588,947.24	150,766,823.12	-
合计	-	-	0.600	75,177,875.88	75,588,947.24	150,766,823.12	-

**6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发、增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 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。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，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，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由监察稽核部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。监察稽核部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

#### 6.4.13.2 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。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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011年6月30日	上年末 2010年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	19,862,000.00	138,457,500.00
合计	19,862,000.00	138,457,500.00

注：本基金持有的未评级的债券均为国债、中央银行票据或政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011年6月30日	上年末 2010年12月31日
AAA	11,899,038.10	10,389,460.20
AAA 以下	-	-

未评级	67,585,000.00	-
合计	79,484,038.10	10,389,460.20

#### 6.4.13.3 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余部分在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金资产净值的 40%。

除卖出回购金融资产款合约约定到期日均为一个月以内计息外，本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6 月30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	384,339,	-	-	-	-	-	384,339,

	186.26						186.26
结算备付金	3,522,753.77	-	-	-	-	-	3,522,753.77
存出保证金	-	-	-	-	-	6,473,751.67	6,473,751.67
交易性金融资产	19,862,000.00	-	79,484,038.10	-	-	2,078,021,425.72	2,177,367,463.82
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	196,000,298.00	-	-	-	-	-	196,000,298.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	732,437.66	732,437.66
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	713,208.58	-	-	-	-	-	713,208.58
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	604,437,446.61	-	79,484,038.10	-	-	2,085,227,615.05	2,769,149,099.76
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	15,278,413.94	15,278,413.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,808,698.80	1,808,698.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,306,876.73	3,306,876.73
应付托管费	-	-	-	-	-	551,146.12	551,146.12
应付销售	-	-	-	-	-	-	-

服务费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,416.70 1.74	8,416.70 1.74
应交税费	-	-	-	-	-	2,208.00	2,208.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	3,197.81 2.49	3,197.81 2.49
负债总计	-	-	-	-	-	32,561.8 57.82	32,561.8 57.82
利率敏感度缺口	604,437, 446.61	-	79,484.0 38.10	-	-	2,052.66 5,757.23	2,736.58 7,241.94
上年度末 2010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	692,923, 318.52	-	-	-	-	-	692,923, 318.52
结算备付 金	29,029.1 79.24	-	-	-	-	-	29,029.1 79.24
存出保证 金	-	-	-	-	-	7,262.87 8.16	7,262.87 8.16
交易性金 融资产	-	138,457, 500.00	-	-	10,389.4 60.20	2,958.32 3,045.78	3,107.17 0,005.98
应收利息	-	-	-	-	-	3,869.87 2.16	3,869.87 2.16
应收申购 款	9,968.71 1.78	-	-	-	-	-	9,968.71 1.78
资产总计	731,921, 209.54	138,457, 500.00	-	-	10,389.4 60.20	2,969.45 5,796.10	3,850.22 3,965.84
负债							
应付证券 清算款	-	-	-	-	-	80,965.1 70.24	80,965.1 70.24
应付赎回	-	-	-	-	-	5,193.68	5,193.68

款						9.29	9.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,786.32	4,786.32
应付托管费	-	-	-	-	-	9.50	9.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	797,721.57	797,721.57
应交税费	-	-	-	-	-	11,814.24	11,814.24
其他负债	-	-	-	-	-	2,208.00	2,208.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,357.89	3,357.89
利率敏感度缺口	731,921,209.54	138,457,500.00	-	-	10,389,460.20	2,862.53	3,743.30
						8,535.89	6,705.63

注：本表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	利率下降25个基点	增加29.69万元	增加19.71万元
	利率上升25个基点	减少29.04万元	减少19.24万元

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010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	2,078,021,425.72	75.93	2,958,323,045.78	79.03
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,078,021,425.72	75.93	2,958,323,045.78	79.03

注：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%。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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		
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）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	业绩基准下跌1%	减少2,627.12万元	减少3,518.71万元
	业绩基准下跌5%	减少13,135.62万元	减少17,593.54万元
	业绩基准下跌10%	减少26,271.24万元	减少35,187.08万元

注：报告期内，本基金 beta 值为 0.96，2010 年为 0.94。

#### 6.4.14 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。

## 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	2,078,021,425.72	75.04
	其中：股票	2,078,021,425.72	75.04
2	固定收益投资	99,346,038.10	3.59
	其中：债券	99,346,038.10	3.59
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	196,000,298.00	7.08
	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	387,861,940.03	14.01
6	其他各项资产	7,919,397.91	0.29
7	合计	2,769,149,099.76	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	11,896,586.93	0.43
B	采掘业	105,113,368.54	3.84
C	制造业	1,679,752,637.25	61.38
C0	食品、饮料	459,261,053.37	16.78
C1	纺织、服装、皮毛	80,570,339.85	2.94
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	4,258,470.00	0.16
C4	石油、化学、塑胶、塑料	282,270,939.64	10.31
C5	电子	17,210,335.02	0.63
C6	金属、非金属	112,239,932.94	4.10
C7	机械、设备、仪表	340,356,257.24	12.44
C8	医药、生物制品	383,585,309.19	14.02
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	158,117,035.53	5.78
F	交通运输、仓储业	16,276,160.00	0.59
G	信息技术业	28,278,359.76	1.03
H	批发和零售贸易	5,196,100.00	0.19
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	4,978,199.15	0.18
K	社会服务业	68,412,978.56	2.50
L	传播与文化产业	-	-

M	综合类	-	-
	合计	2,078,021,425.72	75.93

## 7.3 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	3,347,892	266,090,456.16	9.72
2	000423	东阿阿胶	5,290,550	218,288,093.00	7.98
3	600143	金发科技	8,988,403	147,949,113.38	5.41
4	002140	东华科技	4,993,678	137,076,461.10	5.01
5	000568	泸州老窖	2,909,828	131,291,439.36	4.80
6	600690	青岛海尔	4,584,682	128,141,861.90	4.68
7	600425	青松建化	5,390,967	112,239,932.94	4.10
8	600535	天士力	2,599,846	106,931,665.98	3.91
9	000780	平庄能源	5,308,977	84,412,734.30	3.08
10	000792	盐湖股份	1,414,072	83,430,248.00	3.05
11	002293	罗莱家纺	1,038,947	80,570,339.85	2.94
12	000527	美的电器	4,241,533	78,001,791.87	2.85
13	000651	格力电器	2,926,954	68,783,419.00	2.51
14	600809	山西汾酒	883,357	61,879,157.85	2.26
15	000069	华侨城 A	6,949,180	54,968,013.80	2.01
16	600803	威远生化	3,710,402	48,717,578.26	1.78
17	002223	鱼跃医疗	1,550,179	38,025,890.87	1.39
18	600518	康美药业	2,748,313	36,167,799.08	1.32
19	000063	中兴通讯	999,942	28,278,359.76	1.03
20	000597	东北制药	1,586,687	22,197,751.13	0.81
21	600970	中材国际	769,871	21,040,574.43	0.77
22	601088	中国神华	686,816	20,700,634.24	0.76
23	600009	上海机场	1,271,575	16,276,160.00	0.59
24	002073	软控股份	758,977	15,634,926.20	0.57
25	300015	爱尔眼科	420,681	13,444,964.76	0.49
26	600108	亚盛集团	1,959,899	11,896,586.93	0.43
27	002214	大立科技	219,772	9,872,158.24	0.36
28	600060	海信电器	546,809	7,338,176.78	0.27
29	000581	威孚高科	183,234	7,063,670.70	0.26
30	600859	王府井	130,000	5,196,100.00	0.19
31	002285	世联地产	277,337	4,978,199.15	0.18
32	000418	小天鹅 A	292,945	4,704,696.70	0.17

33	002292	奥飞动漫	224,130	4,258,470.00	0.16
34	600486	扬农化工	100,000	2,174,000.00	0.08

#### 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	000423	东阿阿胶	239,468,470.72	6.40
2	000568	泸州老窖	228,849,447.29	6.11
3	000527	美的电器	193,779,960.40	5.18
4	000651	格力电器	187,836,112.63	5.02
5	000069	华侨城 A	178,708,498.49	4.77
6	600425	青松建化	172,947,769.52	4.62
7	600143	金发科技	171,653,925.13	4.59
8	000968	煤气化	164,997,493.22	4.41
9	002140	东华科技	154,665,354.21	4.13
10	601699	潞安环能	131,026,172.66	3.50
11	601088	中国神华	126,363,981.91	3.38
12	600535	天士力	122,030,729.32	3.26
13	600395	盘江股份	120,083,887.42	3.21
14	601101	昊华能源	118,249,050.96	3.16
15	000063	中兴通讯	100,919,558.82	2.70
16	600660	福耀玻璃	89,321,091.51	2.39
17	000157	中联重科	86,210,963.75	2.30
18	002293	罗莱家纺	85,095,151.78	2.27
19	600803	威远生化	83,995,160.37	2.24
20	601117	中国化学	81,011,230.86	2.16
21	000792	盐湖股份	80,899,757.70	2.16
22	000780	平庄能源	78,239,262.97	2.09
23	600009	上海机场	76,351,423.14	2.04
24	000597	东北制药	75,693,380.90	2.02

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

##### 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	600809	山西汾酒	248,103,161.64	6.63

2	000968	煤气化	247,249,441.92	6.61
3	002431	棕榈园林	219,305,260.27	5.86
4	000651	格力电器	194,206,640.92	5.19
5	000069	华侨城 A	192,534,878.40	5.14
6	002375	亚厦股份	167,635,575.01	4.48
7	601699	潞安环能	157,206,162.07	4.20
8	002223	鱼跃医疗	151,996,358.11	4.06
9	000423	东阿阿胶	143,782,090.84	3.84
10	600970	中材国际	136,624,252.98	3.65
11	601101	昊华能源	124,040,903.32	3.31
12	600395	盘江股份	122,356,410.62	3.27
13	000568	泸州老窖	119,992,313.58	3.21
14	000527	美的电器	113,537,865.96	3.03
15	600690	青岛海尔	104,389,386.34	2.79
16	601088	中国神华	99,825,956.83	2.67
17	601601	中国太保	97,869,409.43	2.61
18	601117	中国化学	95,761,367.41	2.56
19	600535	天士力	89,343,483.80	2.39
20	600660	福耀玻璃	85,637,223.64	2.29
21	000157	中联重科	84,643,393.31	2.26

注：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。

#### 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	5,680,471,972.59
卖出股票的收入（成交）总额	6,172,755,765.67

注：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。

#### 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	87,447,000.00	3.20
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	中期票据	-	-
7	可转债	11,899,038.10	0.43

8	其他	-	-
9	合计	99,346,038.10	3.63

### 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	1101022	11 央票 22	700,000	67,585,000.00	2.47
2	1101019	11 央票 19	200,000	19,862,000.00	0.73
3	113001	中行转债	94,570	9,984,700.60	0.36
4	110015	石化转债	17,750	1,914,337.50	0.07

### 7.7 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。

### 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。

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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,473,751.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	732,437.66
5	应收申购款	713,208.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,919,397.91

**7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	9,984,700.60	0.36

**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**

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。

**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
127,486	17,203.23	656,233,955.80	29.92%	1,536,937,557.33	70.08%

**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(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	2,524,442,353.47
本报告期基金总申购份额	518,253,631.69
减：本报告期基金总赎回份额	849,524,472.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,193,171,513.13

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。

## 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无重大人事变动。

2011 年 1 月 21 日,中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格(证监许可【2011】116 号),张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

### 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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	2,916,411,036.78	24.66%	2,409,642.29	24.51%	-
中信证券	2	1,617,795,880.23	13.68%	1,314,469.64	13.37%	-
中金公司	2	991,291,709.16	8.38%	835,795.73	8.50%	-
申银万国	2	924,666,491.61	7.82%	763,570.33	7.77%	-
东方证券	1	757,510,613.16	6.40%	615,482.03	6.26%	-
中银国际	2	743,153,653.87	6.28%	631,677.39	6.43%	-
信达证券	1	656,378,968.28	5.55%	557,920.44	5.68%	-
国信证券	1	647,437,887.84	5.47%	550,321.73	5.60%	-
招商证券	1	636,164,283.03	5.38%	516,889.72	5.26%	-
国金证券	1	484,679,956.16	4.10%	411,975.96	4.19%	-
东海证券	1	444,958,512.57	3.76%	378,212.58	3.85%	-
高华证券	1	359,182,205.30	3.04%	291,839.95	2.97%	-
东兴证券	1	287,016,236.55	2.43%	243,963.93	2.48%	-
大通证券	1	283,747,122.90	2.40%	241,182.99	2.45%	-
齐鲁证券	1	78,133,180.82	0.66%	66,413.66	0.68%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
合计	34	11,828,527,738.26	100.00%	9,829,358.37	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五个，分别为东兴证券、华泰联合证券、瑞银证券、中银国际、中信证券交易单元。

### 10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	200,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	200,000,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 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旗下部分基金增加中国建设银行股份有限公司为代销机构并推出定期定额及转换业务同时参与网上交易费率和定期定额申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-06
2	《东吴基金管理有限公司关于恢复旗下基金大额申购、转入业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-07
3	《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-18
4	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金2010年第4季度报告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-24
5	《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》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-28
6	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在温州银行股份有限公司网上银行申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-31
7	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在招商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-02-17
8	《2011年度东吴价值成长双动力股票型证券投资基金分红公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-02-28
9	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在天相投资顾问有限公司推出定期定额投资业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-07
10	《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-17
11	《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-26
12	《东吴基金关于旗下基金产品持有盐湖钾肥股票恢复市价估值法的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-29
13	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金2010年年度报告摘要》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-31
14	《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电子银行延长基金申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-31
15	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加华夏银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-06
16	《东吴基金关于旗下基金产品持有大立科技股票恢复市价估值法的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-07

17	《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延长定期定额申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-08
18	《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网上银行基金申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-12
19	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金2011年第1季度报告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-21
20	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增中信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》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-05-05
21	《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理变更公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-05-14
22	《东吴基金管理有限公司关于开通400全国统一客服热线的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-06-01
23	《东吴基金关于旗下基金产品持有海印股份股票恢复市价估值法的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-06-23
24	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-06-30

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 12.3 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 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司  
二〇一一年八月二十七日