

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金
2007 年半年度报告

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

报送日期： 2007 年 8 月 27 日

重要提示

本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根据本基金合同规定,于 2007 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

目录

一、 基金简介.....	1
二、 主要财务指标和基金净值表现.....	2
三、 管理人报告.....	3
四、 托管人报告.....	5
五、 财务会计报告.....	5
六、 投资组合报告.....	18
七、 基金份额持有人户数、持有人结构.....	24
八、 基金份额变动情况.....	25
九、 重大事件揭示.....	25
十、 备查文件目录.....	27

一、基金简介

(一) 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

基金代码: 580002(前端) 581002(后端)

基金运作方式: 契约型开放式

基金合同生效日: 2006年12月15日

报告期末基金份额总额: 2,087,616,790.46

基金合同存续期: 不定期

(二) 基金投资目标: 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: $75% \times \text{新华富时 A600 指数} + 25% \times \text{中信标普全债指数}$ 。

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。

(三) 基金管理人名称: 东吴基金管理有限公司

注册地址: 上海市源深路 279 号

办公地址: 上海市源深路 279 号

邮政编码: 200135

法定代表人: 吴永敏

信息披露负责人: 黄忠平

联系电话: 021-50509888-8219

传真: 021-50509888-8211

电子邮箱: huangzhp@scfund.com.cn

(四) 基金托管人名称: 中国农业银行

注册地址：北京市海淀区复兴路甲 23 号

办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

邮政编码：100037

法定代表人：项俊波

信息披露负责人：李芳菲

联系电话：010-68424199

传真：010-68424181

电子邮箱：lifangfei@abchina.com

(五) 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

登载半年度报告正文的管理人互联网网址：<http://www.scfund.com.cn>

基金半年度报告置备地点：基金管理人及托管人办公处

(六) 其他有关资料：

会计师事务所：江苏公正会计师事务所有限公司

办公地址：江苏无锡市新区旺庄路 52 号

注册登记机构：东吴基金管理有限公司

办公地址：上海市源深路 279 号

二、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

财务指标	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
基金本期净收益	714,455,570.44
基金份额本期净收益	0.3693
期末可供分配基金收益	975,617,680.22
期末可供分配基金份额收益	0.4673
期末基金资产净值	3,455,098,129.38
期末基金份额净值	1.6550
基金加权平均净值收益率	27.37%
本期基金份额净值增长率	62.25%
基金份额累计净值增长率	65.50%

2、基金净值表现

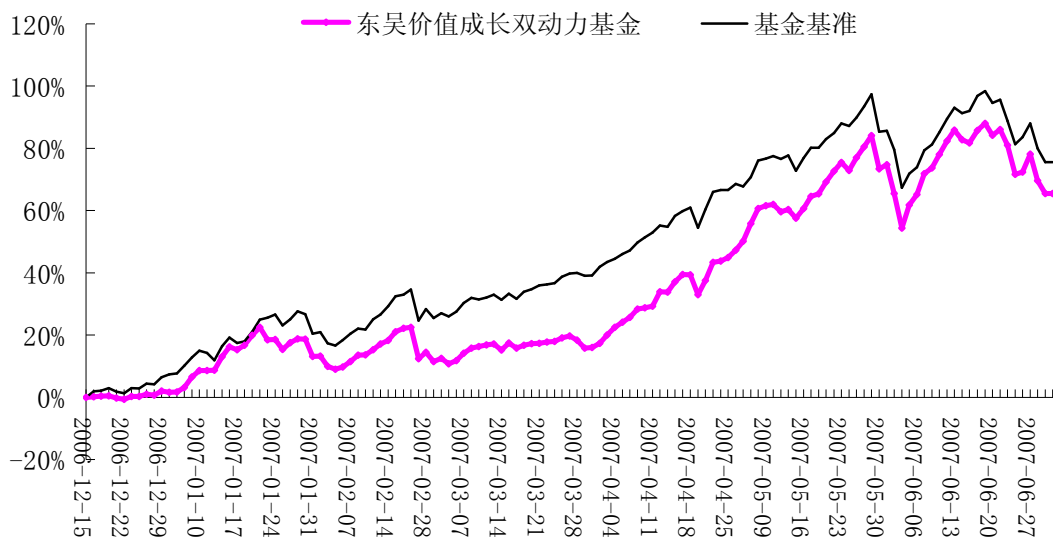
(1) 东吴价值成长双动力基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

时间	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
最近一个月	-5.31%	3.25%	-4.78%	2.39%	-0.53%	0.86%
最近三个月	42.67%	2.58%	23.82%	1.96%	18.85%	0.62%
最近六个月	62.25%	2.32%	63.61%	1.90%	-1.36%	0.42%
自基金合同生效以来	65.50%	2.21%	75.64%	1.85%	-10.14%	0.36%

注：比较基准=75%*新华富时 A600 指数+25%*中信标普全债指数。

(2) 东吴价值成长双动力基金累计净值增长率历史走势图：

自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较：



注：东吴价值成长双动力基金于2006年12月15日成立。

三、管理人报告

(一) 基金管理人介绍

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。

截止2007年6月30日，本基金管理人于2005年2月1日发起成立并管理第一只基金——东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金；2006年12月15日发起成立并管理其第二只基金——东吴价值成长双动力股票型证券投资基金。

（二）基金经理介绍

王炯女士，毕业于武汉大学，获硕士学位，九年证券行业研究和投资经历。曾在大鹏证券研究所和投资部担任研究员/首席分析师助理等职务，2004年加入东吴基金。现担任投资管理部副总经理，东吴双动力基金经理。

（三）基金运作合规性声明

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

（四）基金经理工作报告

2007年上半年，指数由年初2700点于4月初突破3000点后，加速放量上涨，一路上行至4335.96点，在上调印花税利空政策的冲击下，展开一轮近千点的暴跌走势，之后快速回升，短期再度回升至4000点上方，跌宕起伏。同期成长类、题材股表现出色。深综指同期最高涨幅为134.74%。部分垃圾股鸡犬升天，最高者上升近10倍。

在过热的宏观经济背景下，各路游资大举入市，2007年A股新增开户数明显上升，5月28日并创下日新增开户数38.5万户的历史记录。新增开户市上升直接反映了A股市场散户入市的热情。另外，随着散户蜂拥入市，市场换手率也大幅提高，市场月换手率从2006年的约40%快速上升至目前约100%的水准，日换手率也持续在4%-5%的水准。

尽管是老话重提，但这是我们必须反复强调的理念，即使在市场亢奋的大牛市下依然有效：上市公司业绩的不断提升是支撑股价上涨的主要动力，如果说仅仅依靠政策的呵护，没有半年度70%的上市公司业绩预增50%的大环境的话，指数在4000点能否有效徘徊可能还是未知数。目前上市公司的业绩提升导致了市场估值的上升，由此引发了市场预期不断加强的正反馈。但是，A股市场的估值水平无论从那个角度去衡量，都没有了任何优势。市场的上涨，已经演变为在人民币升值预期的流动性泛滥下，市场进行资产重估的逐步升级。

尽管是长期的牛市趋势，资产的重估仍将有阶段性的结束。没有隐患的单边式上涨，已经在进行风险的积累，尤其是当大盘过了5000点后潜在的调整忧患，不能不使我们保留一定的冷静和清醒。对于今年下半年的市场我们基本以震荡的格局去进行预期。流动性过剩、消费指数的不断处于上升必然会导致宏观调控措施的不断实施，开始时的小幅度没有对市场

造成很大影响,如果长时间的进行累计其利空必然会造成相应的冲击。对于投资的资产配置,我们仍将围绕人民币升值的主题进行配置,同时也注重价值型投资品种和资产注入品种的选择。

四、托管人报告

在托管东吴价值增长双动力证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《东吴价值增长双动力证券投资基金基金合同》、《东吴价值增长双动力证券投资基金托管协议》的约定,对东吴价值增长双动力证券投资基金管理人——东吴基金管理有限公司 2007 年 1 月 1 日至 2007 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。

本托管人认为,东吴基金管理有限公司在东吴价值增长双动力证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,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按照基金合同的规定进行。

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增长双动力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。

中国农业银行托管业务部

2007 年 8 月 24 日

五、财务会计报告

(一) 基金半年度会计报表

1、东吴价值成长双动力基金 2007 年 6 月 30 日资产负债表

单位:人民币元

资产	附注	2007-6-30	2006-12-31
资产:			
银行存款		245,831,462.63	1,293,936,256.44
清算备付金		29,726,467.26	0.00

交易保证金		6,946,077.84	250,000.00
应收证券清算款		0.00	0.00
应收股利		0.00	0.00
应收利息	7 (1)	579,031.80	285,835.16
应收申购款		19,565,021.01	0.00
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		3,262,063,076.53	1,272,549,551.76
其中：股票投资成本		3,123,269,133.27	1,237,705,365.75
债券投资市值		39,077,960.00	0.00
其中：债券投资成本		39,077,960.00	0.00
权证投资市值		33,436,294.35	0.00
其中：权证投资成本		33,959,970.32	0.00
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用		0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产总计		3,637,225,391.42	2,567,021,643.36
负债：			
应付证券清算款		108,274,697.58	376,803,443.73
应付赎回款		58,553,708.52	0.00
应付赎回费		221,042.32	0.00
应付管理人报酬		4,537,813.90	1,414,176.49
应付托管费		756,302.32	235,696.09
应付销售费		0.00	0.00
应付佣金	7 (3)	8,473,995.58	1,237,923.23
应付利息		0.00	0.00
应付收益		0.00	0.00
未交税金		0.00	0.00
其他应付款	7 (4)	1,096,467.53	250,000.00
卖出回购证券款		0.00	0.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	7 (5)	213,234.29	0.00
其他负债			0.00
负债合计：		182,127,262.04	379,941,239.54
持有人权益：			
实收基金	7 (6)	2,087,616,790.46	2,144,214,669.67
未实现利得	7 (7)	391,863,658.70	34,844,186.01
未分配收益		975,617,680.22	8,021,548.14
持有人权益合计：		3,455,098,129.38	2,187,080,403.82

负债及持有人权益总计		3,637,225,391.42	2,567,021,643.36
------------	--	------------------	------------------

2、东吴价值成长双动力基金经营业绩表

2007年1月1日到2007年6月30日期间

单位：人民币元

项 目	附注	2007-1-1 至 2007-6-30
一、收入		737,177,593.63
1. 股票差价收入	7 (8)	695,557,947.75
2. 债券差价收入		0.00
3. 权证差价收入	7 (9)	28,763,305.04
4. 债券利息收入		505,596.16
5. 存款利息收入		2,126,248.19
6. 股利收入		5,892,090.47
7. 买入返售证券收入		0.00
8. 其他收入	7 (10)	4,332,406.02
二、费用		22,722,023.19
1. 基金管理人报酬		19,224,104.08
2. 基金托管费		3,204,017.38
3. 基金销售费		0.00
4. 卖出回购证券支出		51,885.15
5. 利息支出		0.00
6. 其他费用	7 (11)	242,016.58
其中：交易费用		326.40
信息批露费		168,603.31
审计费用		44,630.98
账户维护费		4500.00
汇划费		23,955.89
三、基金净收益		714,455,570.44
加：未实现利得		103,426,081.28
四、基金经营业绩		817,881,651.72

3、东吴价值成长双动力基金收益分配表

2007年1月1日到2007年6月30日期间

单位：人民币元

项 目	附注	2007-1-1 至 2007-6-30
本期基金净收益		714,455,570.44
加：期初基金净收益		8,021,548.14

加：本期损益平准金		253,140,561.64
可供分配基金净收益		975,617,680.22
减：本期已分配基金净收益		0.00
期末基金净收益		975,617,680.22

4、东吴价值成长双动力基金净值变动表

2007年1月1日到2007年6月30日期间

单位：人民币元

项目	附注	2007-1-1至2007-6-30
一、期初基金净值		2,187,080,403.82
二、本期经营活动		
基金净收益		714,455,570.44
未实现利得	7(7)	357,019,472.69
经营活动产生的基金净值变动数		1,071,475,043.13
三、本期基金单位收益		
基金申购款		3,195,705,783.78
其中：红利在投资款		0.00
基金赎回款		2,999,163,101.35
基金单位交易产生的基金净值变动数		196,542,682.43
四、本期向持有人分配收益		
向持有人分配收益产生的基金净值变动数		0.00
五、以前年度损益调整		0.00
因损益调整产生的基金净值变动数		0.00
六、基金期末净值		3,455,098,129.38

(二) 会计报表附注

1、基金简介

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]173号文《关于同意东吴价值成长双动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准向社会公开发行募集,基金合同于2006年12月15日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期不定。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。

本基金的募集期间为2006年11月21日至2006年12月12日。经江苏公正会计师事务所验资,募集的有效净认购金额为2,143,948,051.49元人民币,折合基金份额

2,143,948,051.49份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计266,618.18元人民币，折合基金份额266,618.18份。

2、主要会计政策

(1) 会计报表编制基础

本基金会计报表的编制遵循《企业会计准则》和《证券投资基金会计核算办法》及中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号〈半年度报告的内容与格式〉》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号〈会计报表附注的编制及披露〉》和《证券投资基金信息披露编报规则第4号〈基金投资组合报告的编制及披露〉》。

(2) 会计年度

为公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2007年1月1日至2007年6月30日止。

(3) 记账本位币

人民币。

(4) 记账基础和计价原则

以权责发生制为记账基础，除股票投资、债券投资和权证投资按本附注所述的估值方法计价外，其余报表项目均以历史成本计价。

(5) 本基金估值方法：

① 上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值；该日无交易的证券，以最近一个交易日的收盘价计算；

② 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的收盘价估值，该日无交易的，以最近一个交易日的收盘价计算；

B. 首次公开发行的股票，按其成本价估值；

C. 非公开发行的股票的估值

根据基金部通知[2006]37号文《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的非公开发行股票的初始取得成本时，应按以下公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr) / D1$$

(其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的非公开发行股票的初始取得成本；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数，不含估值日当天。)

③ 上市债券以不含息价格计价，按估值日证券交易所挂牌的收盘价计算后的净价估值；该日无交易的，以最近交易日净价估值，并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内逐日计提利息；

④ 未上市债券和在银行间同业市场交易的债券以不含息价格计价，按成本估值，并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内计提利息；

⑤ 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值；该日无交易的权证，以最近一个交易日的收盘价计算；

⑥ 未上市流通的权证，由基金管理人和托管人综合考虑市场情况、标的股票价格、行权价格、剩余期限、市场无风险利率、标的股票价格波动等因素，按照最能反映权证公允价值的价格估值；

⑦ 配股权证，从配股除权日到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价等于或低于配股价，则估值额为零；

⑧ 分离交易可转债，上市日前，按以下方法分别计算债券和权证的估值：获得分离交易可转债的债券部分时，按成本估值；获得权证部份后，按照中国证券业协会公布的债券报价和权证报价分别确定当日债券和权证的估值；

自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述③、⑤原则进行估值；

⑨ 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映资金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

⑩ 如有新增事项，按国家最新规定估值。

(6) 证券投资的成本计价方法

① 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账；因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票差价收入/（损失），出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

② 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所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；

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所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；

买入央行票据和零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/（损失）；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/（损失）。出售债券的成本按移动加权平均法结转；

③ 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的全部价款入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认权证差价收入/（损失），出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

④ 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于权益登记日获得债券，按分离交易可转债的面值确认债券成本；于权证获得日，根据中国证券业协会公布的债券和权证的报价计算出两者分别占面值的比例，根据此比例来确认债券和权证分别应承担的成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述②、③中相关原则进行计算。

(7) 收入的确认和计量

① 股票差价收入于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

② 债券差价收入：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于实际收到价款时确认债券差价收入，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；

③ 权证差价收入于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

④ 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

⑤ 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

⑥ 股利收入于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

⑦ 买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账；

⑧ 其他收入于实际收到时确认收入。

(8) 费用的确认和计量

① 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

② 基金托管费按前一日的基金资产净值的 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规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

(9) 基金申购、赎回的确认

① 确认申购份额时，保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。

A: 2007年6月1日前，采用内扣法确认份额：

基金申购费用 = 申购金额 × 申购费率

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

B: 2007年6月1日起，采用外扣法确认份额：

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

净申购金额 = 实收基金 + 未实现利得平准金 + 损益平准金

申购份额 = 净申购金额 / 交易日基金份额净值

实收基金 = 申购份额 × 1元

未实现利得平准金 = (交易日未实现利得 / 交易日净资产) × 净申购金额

损益平准金 = (交易日未分配利润 / 交易日净资产) × 净申购金额

投资者选择红利自动再投资，不收取申购费用。

② 确认赎回总额时，保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。

赎回总额 = 赎回份额 × 交易日基金份额净值

= 实收基金 + 未实现利得平准金 + 损益平准金

实收基金 = 赎回份额 × 1元

未实现利得平准金 = (交易日未实现利得 / 交易日净资产) × 赎回总额

损益平准金 = (交易日未分配利润 / 交易日净资产) × 赎回总额

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

交易日的基金份额净值在当天收市后计算。

(10) 基金的收益分配政策

① 每一基金单位享有同等分配权；

② 投资者可以选择现金分红方式或红利再投资分红方式，默认分红方式为获取现金红利；

③ 基金收益每年最多分配八次，年度收益分配比例不低于已实现收益的 50%；

- ④基金投资当期亏损, 则不进行收益分配;
- ⑤基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值;
- ⑥基金当期收益应先弥补前期亏损后, 才可进行当期收益分配;
- ⑦在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金收益每年至少分配一次, 但若成立不满 3 个月则可不进行收益分配;
- ⑧法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

3、主要税项

根据《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》财税[2004]78 号文件规定, 证券投资基金自 2004 年 1 月 1 日起, 继续免征企业所得税和营业税。

根据《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》财税[2007]84 号文件规定, 从 2007 年 5 月 30 日起, 调整证券(股票)交易印花税税率, 由原先的 1% 调整为 3%。

根据《财政部国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》财税[2002]128 号文件规定, 对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入, 由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

根据《财政部国家税务总局关于股息红利个人所得税有关政策的通知》财税[2005]102 号文件, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 暂减按 50% 计入个人应纳税所得额。

4、资产负债表日后事项

根据中国证监会相关规定, 本基金于 2007 年 7 月 1 日起实施新会计准则。实施新会计准则后, 基金将全面采用公允价值进行会计计量, 基金估值方法及个别会计政策会有一定变更。

5、本报告期内无重大会计错误。

6、关联方关系及交易

(1) 关联方关系

序号	主要关联方名称	关联关系
1	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
2	中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
3	东吴证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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

(2) 通过关联方席位进行的交易

基金管理人声明：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

关联方	股票交易金额	占成交总额比例
东吴证券	8,763,693,957.79	43.59%

关联方	支付佣金	占佣金总量比例
东吴证券	7,049,931.96	43.52%

(3) 关联方报酬

A: 基金管理人报酬

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。

本基金在本期需支付基金管理人报酬 19,224,104.08 元。

B: 基金托管费

支付基金托管人中国农业银行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。

本基金在本期需支付基金托管费 3,204,017.38 元。

(4) 本基金管理公司、股东及其股东所控制的机构均未持有基金份额。

(5) 2007 年 6 月 30 日由本基金托管人中国农业银行保管的银行存款余额为 245,831,462.63 元，本报告期内产生的利息收入为 1,740,944.12 元。

7、基金会计报表重要项目的说明

(1) 应收利息

明细项目	2007 年 6 月 30 日
------	-----------------

应收银行存款利息	54,629.58
应收债券利息	505,596.16
应收备付金利息	12,039.30
应收保证金利息	0.00
应收申购款利息	6,766.76
合计	579,031.80

(2) 投资估值增值

明细项目	2007年6月30日
股票投资	138,793,943.26
权证投资	-523,675.97
合计	138,270,267.29

(3) 应付佣金

券商名称	2007年6月30日
应付东吴证券佣金	3,949,453.07
应付中信证券佣金	771,630.44
应付西部证券佣金	1,439,479.22
应付招商证券佣金	821,402.25
应付东方证券佣金	1,492,030.60
合计	8,473,995.58

(4) 其他应付款

明细项目	2007年6月30日
应付后端申购费	96,291.13
应付券商保证金	1,000,000.00
应付回购交易费	176.40
合计	1,096,467.53

(5) 预提费用

明细项目	2007年6月30日
预提信息披露费	168,603.31
预提审计费	44,630.98
合计	213,234.29

(6) 实收基金:

期初数	2,144,214,669.67
-----	------------------

加：本期因申购的增加数	2,407,879,867.48
减：本期因赎回的减少数	2,464,477,746.69
期末数	2,087,616,790.46

(7) 未实现利得

明细项目	投资估值增值	未实现利得平准金	合计
期初数	34,844,186.01	0.00	34,844,186.01
本期净变动数	103,426,081.28	-	103,426,081.28
加：本期申购	-	720,326,778.21	720,326,778.21
减：本期赎回	-	466,733,386.80	466,733,386.80
期末数	138,270,267.29	253,593,391.41	391,863,658.70

(8) 股票差价收入：

卖出股票成交总额	9,469,703,575.52
减：卖出股票成本总额	8,766,218,679.63
应付佣金总额	7,926,948.14
股票差价收入	695,557,947.75

(9) 权证差价收入：

卖出权证成交总额	371,340,859.79
减：卖出权证成本总额	342,577,554.75
权证差价收入	28,763,305.04

(10) 其他收入：

赎回费收入	4,332,406.02
合计	4,332,406.02

(11) 其他费用：

信息披露费	168,603.31
审计费	44,630.98
帐户维护费	4,500.00
交易费用	150.00
回购交易费用	176.40
汇划费	23,955.89
合计	242,016.58

8、期末本基金因处于新股网下中签锁定期流通转让受到限制的基金资产如下：

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	成本	市值	上市日	可流通日
1	601998	中信银行	108,848	631,318.40	1,001,401.60	20070427	20070727
2	002126	银轮股份	20,922	175,326.36	377,851.32	20070418	20070718

六、投资组合报告

(一) 期末基金资产组合情况

项 目	金 额	占基金总资产的比例
股票	3,262,063,076.53	89.69%
债券	39,077,960.00	1.07%
权证	33,436,294.35	0.92%
银行存款和清算备付金	275,557,929.89	7.58%
其他资产	27,090,130.65	0.74%
合计	3,637,225,391.42	100.00%

(二) 期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值	占基金总资产比例
A 农、林、牧、渔业	61,598,735.38	1.78%
B 采掘业	0.00	0.00%
C 制造业	1,026,305,212.28	29.70%
C0 食品、饮料	347,629,616.25	10.06%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	30,536,801.74	0.88%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	200,216,056.85	5.79%
C5 电子	48,701,325.32	1.41%
C6 金属、非金属	42,215,711.90	1.22%
C7 机械、设备、仪表	284,265,873.67	8.23%
C8 医药、生物制品	72,739,826.55	2.11%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	176,003,363.22	5.09%
F 交通运输、仓储业	285,113,529.12	8.25%
G 信息技术业	36,037,869.56	1.04%
H 批发和零售贸易	87,715,744.22	2.54%
I 金融、保险业	357,003,618.12	10.33%
J 房地产业	852,126,301.79	24.66%
K 社会服务业	165,050,401.00	4.78%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	215,108,301.84	6.23%
合计	3,262,063,076.53	94.41%

(三) 期末持有股票明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量	证券市值	市值占净值%
1	000568	泸州老窖	7,833,768	329,801,632.80	9.55%
2	600030	中信证券	4,080,332	216,135,186.04	6.26%
3	000652	泰达股份	6,899,859	195,128,012.52	5.65%
4	600675	中华企业	7,912,731	179,698,121.01	5.20%
5	000069	华侨城A	4,146,995	165,050,401.00	4.78%
6	600169	太原重工	7,090,174	162,081,377.64	4.69%
7	000006	深振业A	5,533,568	137,785,843.20	3.99%
8	600048	保利地产	2,840,900	130,482,537.00	3.78%
9	600315	上海家化	3,041,183	124,293,149.21	3.60%
10	600895	张江高科	7,038,155	121,619,318.40	3.52%
11	000002	万科A	6,083,825	116,322,734.00	3.37%
12	600109	成都建投	1,166,862	93,488,983.44	2.71%
13	000908	S 天一科	5,319,837	92,192,775.21	2.67%
14	600004	白云机场	4,837,931	89,985,516.60	2.60%
15	600739	辽宁成大	2,565,538	87,715,744.22	2.54%
16	000758	中色股份	3,215,334	81,347,950.20	2.35%
17	601628	中国人寿	1,600,000	65,776,000.00	1.90%
18	600266	北京城建	2,306,841	65,375,873.94	1.89%
19	002038	双鹭药业	1,743,269	65,372,587.50	1.89%
20	600962	国投中鲁	3,585,491	61,598,735.38	1.78%
21	600748	上实发展	2,783,878	54,174,265.88	1.57%
22	000636	风华高科	5,811,614	48,701,325.32	1.41%
23	600082	海泰发展	3,647,904	47,678,105.28	1.38%
24	000031	中粮地产	2,011,883	45,508,793.46	1.32%
25	600596	新安股份	1,000,000	43,190,000.00	1.25%
26	600000	浦发银行	1,079,792	39,509,589.28	1.14%
27	600325	华发股份	1,299,923	39,426,664.59	1.14%
28	600476	湘邮科技	1,957,516	36,037,869.56	1.04%
29	601166	兴业银行	890,500	31,247,645.00	0.90%
30	600963	岳阳纸业	1,200,818	30,536,801.74	0.88%
31	600970	中材国际	536,026	29,256,299.08	0.85%
32	600052	*ST 广厦	1,931,270	28,930,424.60	0.84%
33	000616	亿城股份	1,600,143	24,306,172.17	0.70%
34	600246	万通先锋	887,900	23,493,834.00	0.68%
35	600985	雷鸣科化	2,536,876	20,777,014.44	0.60%
36	000024	招商地产	373,326	18,330,306.60	0.53%
37	000935	四川双马	1,224,860	18,176,922.40	0.53%
38	600600	青岛啤酒	688,605	17,827,983.45	0.52%
39	600104	上海汽车	1,000,000	17,270,000.00	0.50%
40	000657	中钨高新	1,329,513	15,289,399.50	0.44%

41	002018	华星化工	752,890	11,955,893.20	0.35%
42	600416	湘电股份	348,600	10,464,972.00	0.30%
43	600111	稀土高科	314,500	8,749,390.00	0.25%
44	600436	片仔癀	195,677	7,367,239.05	0.21%
45	600383	金地集团	175,000	5,988,500.00	0.17%
46	601318	中国平安	46,620	3,333,796.20	0.10%
47	000338	潍柴动力	23,935	1,878,897.50	0.05%
48	601998	中信银行	108,848	1,001,401.60	0.03%
49	002126	银轮股份	20,922	377,851.32	0.01%
50	002135	东南网架	1,000	23,240.00	0.00%

(四) 期内股票投资组合的重大变动

1、本期累计买入价值超出期初基金资产净值 2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额	占净值比(%)
1	600030	中信证券	878,597,648.71	40.17%
2	000002	万科A	523,621,474.55	23.94%
3	000568	泸州老窖	417,908,418.53	19.11%
4	600739	辽宁成大	317,183,800.69	14.50%
5	600169	太原重工	315,616,846.50	14.43%
6	600895	张江高科	275,494,668.53	12.60%
7	600675	中华企业	223,422,501.29	10.22%
8	000718	苏宁环球	205,256,519.80	9.38%
9	000031	中粮地产	202,476,976.64	9.26%
10	000001	深发展A	200,348,248.56	9.16%
11	600048	保利地产	192,550,810.83	8.80%
12	600315	上海家化	181,579,950.13	8.30%
13	000652	泰达股份	172,670,484.05	7.90%
14	600600	青岛啤酒	171,292,035.15	7.83%
15	002038	双鹭药业	143,497,954.12	6.56%
16	600416	湘电股份	135,164,996.78	6.18%
17	000069	华侨城A	134,569,500.90	6.15%
18	600109	成都建投	133,455,285.77	6.10%
19	601628	中国人寿	130,685,678.71	5.98%
20	000917	电广传媒	129,455,407.77	5.92%
21	600596	新安股份	126,342,923.67	5.78%
22	000758	中色股份	122,481,927.55	5.60%
23	601006	大秦铁路	122,362,865.30	5.59%
24	600266	北京城建	122,158,748.38	5.59%
25	000006	深振业A	118,642,198.28	5.42%
26	600962	国投中鲁	113,454,091.83	5.19%
27	600528	中铁二局	112,545,403.23	5.15%

28	000839	中信国安	110,520,527.55	5.05%
29	600028	中国石化	108,482,028.47	4.96%
30	600000	浦发银行	103,647,898.80	4.74%
31	600331	宏达股份	100,567,729.04	4.60%
32	600476	湘邮科技	98,632,710.43	4.51%
33	600750	江中药业	96,696,439.24	4.42%
34	600458	时代新材	93,966,822.95	4.30%
35	000657	中钨高新	92,980,743.05	4.25%
36	600489	中金黄金	84,431,776.92	3.86%
37	600029	南方航空	82,858,915.83	3.79%
38	600320	振华港机	81,857,629.18	3.74%
39	000425	徐工科技	78,336,340.88	3.58%
40	600004	白云机场	77,554,798.81	3.55%
41	000908	S 天一科	77,501,319.28	3.54%
42	600115	东方航空	75,741,900.13	3.46%
43	600887	伊利股份	75,356,405.21	3.45%
44	000522	白云山A	74,464,475.18	3.40%
45	600535	天士力	73,998,809.47	3.38%
46	000793	华闻传媒	73,061,428.59	3.34%
47	002018	华星化工	70,379,193.54	3.22%
48	600748	上实发展	69,854,232.24	3.19%
49	000024	招商地产	64,675,476.55	2.96%
50	000933	神火股份	62,164,730.43	2.84%
51	000636	风华高科	61,606,601.43	2.82%
52	600270	外运发展	60,933,939.95	2.79%
53	600161	天坛生物	59,215,720.31	2.71%
54	000046	泛海建设	58,580,248.97	2.68%
55	002046	轴研科技	58,163,394.89	2.66%
56	600859	XD 王府井	58,048,332.59	2.65%
57	000537	广宇发展	57,445,067.97	2.63%
58	600985	雷鸣科化	57,089,964.01	2.61%
59	000858	五粮液	55,258,871.64	2.53%
60	600312	平高电气	54,076,377.57	2.47%
61	601166	兴业银行	53,289,671.28	2.44%
62	600350	山东高速	52,605,048.66	2.41%
63	600521	华海药业	50,835,845.26	2.32%
64	601002	晋亿实业	50,221,491.47	2.30%
65	600036	招商银行	48,989,623.42	2.24%
66	600780	通宝能源	48,937,204.23	2.24%
67	600082	海泰发展	48,756,673.24	2.23%
68	600601	方正科技	47,646,528.13	2.18%
69	600365	通葡股份	47,067,848.65	2.15%
70	600391	成发科技	46,248,790.24	2.11%

71	601111	中国国航	46,163,761.89	2.11%
72	600337	美克股份	44,837,500.72	2.05%

2、本期累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%的股票明细

1	600030	中信证券	647,512,234.33	29.61%
2	000002	万科A	546,191,359.46	24.97%
3	000718	苏宁环球	322,885,545.18	14.76%
4	000568	泸州老窖	314,297,877.74	14.37%
5	600036	招商银行	230,927,004.56	10.56%
6	600739	辽宁成大	225,791,926.13	10.32%
7	000001	深发展A	222,767,268.98	10.19%
8	600169	太原重工	213,106,582.16	9.74%
9	000031	中粮地产	209,493,068.87	9.58%
10	600600	青岛啤酒	192,942,789.42	8.82%
11	600895	张江高科	179,277,227.05	8.20%
12	600161	天坛生物	158,117,286.13	7.23%
13	002038	双鹭药业	153,830,637.35	7.03%
14	601006	大秦铁路	136,882,088.41	6.26%
15	000839	中信国安	136,577,039.06	6.24%
16	000917	电广传媒	126,108,410.27	5.77%
17	600416	湘电股份	120,571,780.75	5.51%
18	600458	时代新材	116,030,615.14	5.31%
19	000858	五粮液	112,928,338.54	5.16%
20	600535	天士力	112,408,475.59	5.14%
21	600528	中铁二局	111,272,702.37	5.09%
22	600315	上海家化	108,207,807.65	4.95%
23	601628	中国人寿	105,205,621.47	4.81%
24	600519	贵州茅台	101,779,562.83	4.65%
25	600750	江中药业	98,943,168.16	4.52%
26	600859	XD王府井	98,761,113.91	4.52%
27	600269	赣粤高速	98,286,258.10	4.49%
28	600028	中国石化	97,782,851.94	4.47%
29	600331	宏达股份	97,343,352.89	4.45%
30	600000	浦发银行	92,086,819.17	4.21%
31	002018	华星化工	89,007,666.76	4.07%
32	600489	中金黄金	87,435,684.57	4.00%
33	600350	山东高速	87,114,035.52	3.98%
34	600962	国投中鲁	84,081,264.26	3.84%
35	600029	南方航空	82,241,719.81	3.76%
36	600383	金地集团	80,913,012.11	3.70%
37	600115	东方航空	80,700,386.81	3.69%

38	000522	白云山A	78,685,082.62	3.60%
39	600320	振华港机	78,311,764.17	3.58%
40	600048	保利地产	76,404,617.60	3.49%
41	600596	新安股份	75,411,597.13	3.45%
42	600675	中华企业	74,392,691.20	3.40%
43	600887	伊利股份	73,748,711.83	3.37%
44	000425	徐工科技	73,219,936.51	3.35%
45	000657	中钨高新	72,015,304.51	3.29%
46	000793	华闻传媒	71,691,746.22	3.28%
47	600312	平高电气	65,183,141.03	2.98%
48	600270	外运发展	62,603,522.23	2.86%
49	000046	泛海建设	61,708,045.14	2.82%
50	000807	云铝股份	59,573,196.17	2.72%
51	000063	中兴通讯	58,203,925.61	2.66%
52	600601	方正科技	57,186,398.43	2.61%
53	002046	轴研科技	56,585,939.37	2.59%
54	600521	华海药业	56,493,789.77	2.58%
55	601002	晋亿实业	56,078,106.27	2.56%
56	600476	湘邮科技	55,257,807.98	2.53%
57	600828	*ST 成商	53,476,440.55	2.45%
58	000933	神火股份	53,299,165.23	2.44%
59	000758	中色股份	52,799,888.92	2.41%
60	600266	北京城建	52,766,082.49	2.41%
61	600809	山西汾酒	52,103,426.94	2.38%
62	600016	民生银行	50,398,793.51	2.30%
63	000429	粤高速A	49,967,667.06	2.28%
64	000537	广宇发展	49,286,245.97	2.25%
65	600780	通宝能源	47,650,683.78	2.18%
66	000920	*ST 汇通	46,279,142.76	2.12%
67	000024	招商地产	45,274,155.52	2.07%
68	601111	中国国航	45,081,167.81	2.06%
69	600391	成发科技	44,191,176.84	2.02%
70	000922	*ST 阿继	44,186,151.10	2.02%

3、整个报告期内买入股票的成本总额为 10,651,785,209.01 元，卖出股票的收入总额 695,557,947.75 元。

(五) 期末持有的债券投资组合

序号	证券代码	证券名称	证券市值	市值占净值%
1	0701004	[07 央票 04]	39,077,960.00	1.13%

(六) 投资组合报告附注

1、本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、期末其他资产的构成

项 目	金 额
应收利息	579,031.80
应收申购款	19,565,021.01
合计	20,144,052.81

4、本报告期间权证投资情况

(1) 报告期末持有的权证明细

序号	权证代码	权证名称	期末数量(份)	市值(元)	占期末净值%	备注
1	580013	武钢 CWB1	5,029,965	30,496,677.80	0.88%	主动投资
2	031003	深发 SFC1	124,912	1,903,658.88	0.06%	获赠
3	031004	深发 SFC2	62,456	1,035,957.67	0.03%	获赠

(2) 报告期内权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	获赠数量(份)	买入数量(份)	买入成本(元)	卖出数量(份)	卖出收入(元)
1	580009	伊利 CWB1		2,299,950	60,454,316.66	2,299,950	2,427,184.33
2	580013	武钢 CWB1		7,629,965	48,503,614.88	2,600,000	424,918.44
3	030002	五粮 YGC1		10,723,161	204,302,444.84	10,723,161	23,325,571.04
4	031001	侨城 HQC1		2,178,900	60,306,052.63	2,178,900	1,939,253.40
5	031002	钢钒 GFC1		500,000	2,971,096.06	500,000	646,377.83
6	031003	深发 SFC1	124,912		0.00		
7	031004	深发 SFC2	62,456		0.00		

七、基金份额持有人户数和持有人结构

(截止 2006 年 6 月 30 日)

本基金份额持有人户数	205,527 户
平均每户持有基金份额	10,157.38 份

项目	份额(份)	占总份额比例%
机构投资者持有基金份额	60,121,160.32	2.88%

个人投资者持有基金份额	2,027,495,630.14	97.12%
合计	2,087,616,790.46	100.00%

八、基金份额变动情况

合同生效日的基金份额总额(份)	2,144,214,669.67
期初基金份额总额(份)	2,144,214,669.67
期末基金份额总额(份)	2,087,616,790.46
期间基金申购总份额(份)	2,407,879,867.48
期间基金赎回总份额(份)	2,464,477,746.69

九、重大事件揭示

(一) 本报告期内未召开基金份额持有人大会决议。

(二) 基金管理人无重大人事变动。

(三) 本报告期内，托管人行长变更。

依据国务院文件，2007年6月16日国务院决定任命项俊波同志为中国农业银行行长。

依据相关法律规定，中国农业银行法定代表人变更为项俊波先生。

(四) 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。

(五) 本报告期内本基金投资策略未改变。

(六) 本报告期内本基金聘任会计师事务所情况：

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为江苏公正会计师事务所，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。

(八) 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。

(九) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

1、报告期内租用各证券公司席位进行的股票成交量统计

序号	券商名称	席位数量	股票交易量	股票交易量比例%	佣金	佣金比例%
1	东吴证券	2	8,763,693,957.79	43.59%	7,049,931.96	43.52%
2	国信证券	1	3,738,051,295.54	18.59%	3,065,189.83	18.92%
3	东方证券	1	1,906,735,051.31	9.48%	1,492,030.60	9.21%
4	金元证券	1	1,874,933,128.44	9.33%	1,537,437.24	9.49%
5	西部证券	1	1,755,471,922.42	8.73%	1,439,479.22	8.89%
6	招商证券	1	1,049,705,422.46	5.22%	821,402.25	5.07%
7	中信证券	1	1,014,101,408.89	5.04%	793,542.37	4.90%

总计		8	20,102,692,186.85	100.00%	16,199,013.47	100.00%
----	--	---	-------------------	---------	---------------	---------

2、报告期内租用各证券公司席位进行的权证成交量统计

券商	权证交易金额	比例
东吴证券	377,566,182.36	50.48%
中信证券	105,592,975.82	14.12%
东方证券	264,719,413.64	35.40%
合计	747,878,571.82	100.00%

(十)、其他重要事项

1、根据证监会计字[2007]15号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》，暂存于以基金管理公司名义开户的相关帐户中的认购、申购款等资金在2006年1月1日至2007年6月30日期间（简称利息期间）生成的利息，最后一次结息日之前的部分已于2007年6月27日划入托管户，最后一次结息日至6月30日期间的利息记应收。

2、根据中国证监会基金部通知[2007]10号文《关于统一规范证券投资基金认（申）购费用及认（申）购份额计算方法有关问题的通知》要求，本基金管理人于2007年6月1日起对申购费用由内扣法调整为外扣法。

3、本基金本期未有收益分派事项。

4、本期未有本公司员工持有该只基金的情况。

十、备查文件目录

需披露备查文件的目录：

- (一) 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
- (二) 《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 法律意见书
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (五) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (六) 《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金托管协议》

(七) 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

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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：021-50509666

东吴基金管理有限公司

2007年8月27日