东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2008年年度报告摘要

2008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:中国工商银行股份有限公司　报告送出日期:2009年3月31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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")根据本基金合同规定,于2009年3月20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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2008年01月01日起至12月31日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称:	东吴嘉禾优势精选混合
基金交易代码:	580001
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2005-02-01
报告期末基金份额总额(份):	4,262,751,307.81

2.2 基金产品说明

投资目标:	分享中国经济成长,以中低风险水平获得中长期较高收益。
投资策略:	在资产配置上,本基金根据各类别资产风险收益水平及本基金风险收益目标,确定大类资产配置比例。在平衡风险收益基础上,把握优势成长,追求中长期较高收益。在股票选择上,本基金根据个股在行业、企业、价格三方面比较优势的分析,精选出具有行业、企业、价格三重比较优势及具有企业、价格两重比较优势的个股作为投资对象。在股票具体操作策略上,将根据经济增长周期、行业生命周期及企业生命周期规律在中长时间段上进行周期持有,同时根据指数及个股运行的时空和量价效应进行中短时间段上的波段操作。
业绩比较基准:	65%*(60%*上证180指数+40%*深证100指数)+35%*中信标普全债指数。
风险收益特征:	本基金定位于中低风险水平,力求通过选股方法、投资策略等,谋求中长期较高收益。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄忠平	蒋松云
	联系电话	021-50509888-8219	010-66105799
	电子邮箱	huangzhp@scfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-50509666	95588
传真		021-50509888-8211	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

3 主要财务指标、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	2008年	2007年	2006年
本期已实现收益	-2,058,264,264.53	1,067,014,169.20	81,118,749.32
本期利润	-2,237,598,056.78	1,093,362,934.96	89,688,423.38
加权平均基金份额本期利润	-0.5012	0.4719	0.9119
本期基金份额净值增长率	-46.85%	99.33%	128.15%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年
期末可供分配基金份额利润	-0.4834	-0.0209	0.1155
期末基金资产净值	2,375,057,679.39	5,176,097,061.62	135,923,412.55
期末基金份额净值	0.5572	1.0483	1.2008

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

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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	-1.90%	1.61%	-9.78%	1.95%	7.88%	-0.34%
过去六个月	-10.42%	1.57%	-19.50%	1.92%	9.08%	-0.35%
过去一年	-46.85%	1.94%	-38.91%	1.96%	-7.94%	-0.02%
过去三年	141.70%	1.77%	73.47%	1.55%	68.23%	0.22%
自基金合同生效起至今	123.69%	1.61%	72.52%	1.42%	51.17%	0.19%

注:比较基准=65%*(60%*上证180+40%*深圳100)+35%*中信标普全债指数。

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

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

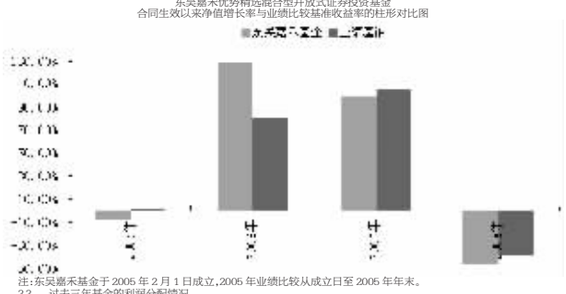
(2005年2月1日至2008年12月31日)

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

3.2.3 过去五年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

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立,2005年业绩比较从成立日至2005年年末。

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
2008年度	-	-	-	-	本期未实施利润分配
2007年度	10.600	564,078,104.31	897,448,131.66	1,461,526,235.97	本期分红三次
2006年度	6.600	24,418,479.30	15,281,255.60	39,699,734.90	本期分红四次
合计	17.200	588,496,583.61	912,729,387.26	1,501,225,970.87	-

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2008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——东吴债信稳健债券型证券投资基金。

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		
魏立波	本基金基金经理	2007-12-29	-	9年	魏立波先生,管理学硕士,曾任东方证券股份有限公司高级研究员、东吴证券有限责任公司证券投资总部总经理助理和东吴基金管理有限公司基金经理助理等职。

注:1.此处的任职日期和离职日期均指公司作出决定之日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》及其他有关法律法规、《东吴嘉禾基金合同》的规定,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 本报告期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,本基金管理人管理的投资组合全部为开放式基金,其中混合型基金1只、股票型基金2只、债券型基金1只。本基金为混合型基金,与其他投资组合无风格相似的情况。

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

2008年的A股市场主定余长留在所有投资者记忆中,国内股票市场整体呈现急转直下的深幅调整态势。我们在一季度对市场调整预期不够充分,但在二季度及时调整了思路,回避了部分市场风险,并在下半年市场出现转机,尤其在政府出台4万亿经济刺激计划后,较成功的判断了市场机会,仓位和行业结构都了灵活的调整,使基金业绩得到一定提升。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2009年,我们认为,A股市场将是休养生息的一年,市场振幅不会太大。宏观经济内外部环境依然复杂,还不能充分判断基本面利空因素都已被市场充分的反应,因此,A股市场依然会受到基本面负面因素困扰。但我们也看到,各国政府本次金融危机中纷纷果断出手,力度和决心都很大,虽然效果如何要到2009年下半年才能体现,但对于恢复市场信心是至关重要的。我们认为上半年市场有可能以此为契机,产生阶段性的反弹,但全年仍将保持振荡整理态势。

根据这种判断,我们在2009年将采取相对灵活的操作策略,重点关注三条投资线索:一是成长性相对确定、国家刺激政策受益行业,如电力设备、铁路设备、医药、军工等。二是估值压力不大的行业重组整合受益个股,尤其对于现金充裕的行业龙头公司。三是关注金融、地产、化工等周期类行业的阶段性反弹机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1)公司有关参与估值流程各方人员,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据的处理及计算,并参与公司对基金的估值方法的计算;督察长、监察稽核业务相关人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。

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

(3)公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

(4)公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2008年,本基金托管人在对东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2008年,东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金的管理人——东吴基金管理有限公司在东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对东吴基金管理有限公司编制和披露的东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金2008年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 审计报告

本报告期基金财务报告经江苏公正天业会计师事务所审计,注册会计师签字出具了苏公W[2009]A130号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

报告截止日:2008年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	830,904,510.50	1,038,886,122.94
结算备付金		10,966,775.72	4,248,887.93
存出保证金		1,538,780.40	5,145,663.37
交易性金融资产	7.4.7.2	1,557,451,390.56	4,112,093,060.58
其中:股票投资		1,020,616,390.56	4,112,093,060.58
债券投资		536,835,000.00	-
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		25,070,387.88	-
应收利息	7.4.7.5	21,451,355.59	5,347,681.72
其中:存款利息收入	7.4.7.11	6,588,108.68	4,872,627.12
债券利息收入		14,508,121.91	1,475.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		355,125.00	473,579.60
其他利息收入		-	-
应收股利		-	-
应收申购款利息		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,412,083,906.69	5,212,967,890.47

负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007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		25,070,387.88	-
应付赎回款		634,759.29	24,503,173.82
应付管理人报酬		3,038,711.03	6,387,903.77
应付托管费		506,451.86	1,064,650.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,840,220.69	3,437,618.27
应交税费		-	60,904.40
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,935,696.55	1,416,577.95
负债合计		37,026,227.30	36,870,828.85
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	4,262,751,307.81	4,937,645,426.08
未分配利润	7.4.7.10	-1,887,693,628.42	238,451,635.54
所有者权益合计		2,375,057,679.39	5,176,097,061.62
负债和所有者权益总计		2,412,083,906.69	5,212,967,890.47

注:报告截止日2008年12月31日,基金份额净值0.5572元,基金份额总额4,262,751,307.81份。

7.2 利润表

会计主体:东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

本报告期:2008年01月01日-2008年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
一、收入		-2,125,843,829.87	1,221,080,154.60
1.利息收入		21,451,355.59	5,347,681.72
其中:存款利息收入	7.4.7.11	6,588,108.68	4,872,627.12
债券利息收入		14,508,121.91	1,475.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		355,125.00	473,579.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,969,170,474.13	1,183,732,173.11
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-1,979,891,389.16	1,133,504,872.45
债券投资收益	7.4.7.13	184,866.09	9,775.49
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	452,749.52	38,968,215.01
股利收益	7.4.7.15	10,083,299.42	11,249,310.16
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-179,333,792.25	26,348,765.76
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	1,209,080.92	5,651,534.01
二、费用(以"-"号填列)		-111,754,226.91	-127,717,219.64
1. 管理人报酬		-47,868,644.25	-40,148,385.75
2. 托管费		-7,978,107.35	-6,691,397.60
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	-55,603,344.71	-80,577,057.25
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	-304,130.60	-300,379.04
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-2,237,598,056.78	1,093,362,934.96
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-2,237,598,056.78	1,093,362,934.96

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

本报告期:2008年01月01日-2008年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2008年01月01日-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)	4,937,645,426.08	238,451,635.54	5,176,097,061.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,237,598,056.78	-2,237,598,056.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以"-"号填列)	-674,894,118.27	111,452,792.82	-563,441,325.45
其中:1.基金申购款	409,967,528.25	-42,244,074.07	367,723,454.18
2.基金赎回款	-1,084,861,646.52	153,696,866.89	-931,164,779.63
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)	4,262,751,307.81	-1,887,693,628.42	2,375,057,679.39

项目	上年度可比期间 2007年01月01日-2007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)	113,191,938.55	22,731,474.00	135,923,412.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,093,362,934.96	1,093,362,934.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以"-"号填列)	4,824,453,487.53	583,883,462.55	5,408,336,950.08
其中:1.基金申购款	8,386,542,089.40	1,559,077,669.25	9,945,619,758.65
2.基金赎回款	-3,562,088,601.87	-975,194,206.70	-4,537,282,808.57
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)	-	-1,461,526,235.97	-1,461,526,235.97
五、期末所有者权益(基金净值)	4,937,645,426.08	238,451,635.54	5,176,097,061.62

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2004]201号文《关于同意东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金设立的批复》的核准,由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集,基金合同于2005年2月1日正式生效,首次设立募集规模为1,029,352,840.95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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资的对象为法律法规允许基金投资的具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。具体比例范围为:30%-95%的基金资产投资股票,投资债券资产不高于基金资产的60%,现金类资产最低比例为5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金执行财政部于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")。

本基金已按照《企业会计准则第38号-首次执行企业会计准则》第五条至第十九条及中国证券监督管理委员会的其他相关规定,对列报的以前年度财务数据予以了追溯调整。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计估计发生变更,其他会计政策等均与最近一期年度报告相一致。

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

根据中国证监会发布的[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会提供的基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》,本基金管理人自2008年9月16日起,对长期停牌股票按指数收益法和沪深证券交易所相应的行业指数进行估值。本基金未持有长期停牌股票,资产净值不受估值方法调整的影响。

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,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 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
活期存款	830,904,510.50	1,038,886,122.94

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2008年12月31日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		1,163,335,656.34	1,020,616,390.56	-142,719,265.78
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	531,142,300.00	536,835,000.00	5,692,700.00
	合计	531,142,300.00	536,835,000.00	5,692,700.00
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,694,477,956.34	1,557,451,390.56	-137,026,565.78

项目		上年度末 2007年12月31日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		4,069,785,834.11	4,112,093,060.58	42,307,226.47
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
其他		4,069,785,834.11	4,112,093,060.58	42,307,226.47

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

本基金本报告期末及上年末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
应收活期存款利息	148,688.23	288,857.13
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	4,935.00	1,912.00
应收债券利息	10,883,239.35	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收权证保证金利息	44.5	48.95
合计	11,036,907.08	290,818.08

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 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
交易所市场交易应付佣金	5,838,005.69	3,437,618.27
银行间交易应付交易费用	2,215.00	-
合计	5,840,220.69	3,437,618.27

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00	1,000,000.00
应付赎回费	1,435.43	92,316.83
预提费用	434,261.12	324,261.12
合计	1,935,696.55	1,416,577.95

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2008年01月01日-2008年12月31日	
	基金份额(份)	帐面金额
上年度末	4,937,645,426.08	4,937,645,426.08
本期申购	409,967,528.25	409,967,528.25
本期赎回	1,084,861,646.52	1,084,861,646.52
本期末	4,262,751,307.81	4,262,751,307.81

7.4.7.10 未分配利润

金额单位: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	-103,168,077.99	341,619,713.53	238,451,635.54
本期利润	-2,058,264,264.53	-179,333,792.25	-2,237,598,056.78
本期基金份额交易产生的变动数	100,629,240.88	10,823,551.94	111,452,792.82
其中:基金申购款	-43,844,382.58	1,600,308.51	-42,244,074.07
基金赎回款	144,473,623.46	9,223,243.43	153,696,866.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,060,803,101.64	173,109,473.22	-1,887,693,628.42

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
活期存款利息收入	6,406,339.33	4,496,388.07
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	162,353.76	159,749.44
存出保证金利息收入	1,622.47	1,622.56
申购款利息收入	17,793.12	214,867.05
合计	6,588,108.68	4,872,627.12

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 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
卖出股票成交总额	9,977,459,562.24	10,017,987,188.87
卖出股票成本总额	11,957,350,951.40	8,884,482,316.42
买卖股票差价收入	-1,979,891,389.16	1,133,504,872.45

7.4.7.13 债券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交金额	851,922,576.64	1,645,855.38
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	837,327,814.20	1,634,604.89
应收利息总额	14,409,896.35	1,475.00
债券投资收益	184,866.09	9,775.49

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 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
卖出权证成交金额	3,044,460.25	67,779,569.08
卖出权证成本总额	2,591,710.73	28,811,354.07
买卖权证差价收入	452,749.52	38,968,215.01

7.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
股票投资产生的股利收益	10,083,299.42	11,249,310.16
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	10,083,299.42	11,249,310.16

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目	本期 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
1.交易性金融资产	-	-
——股票投资	-185,026,492.25	26,348,765.76
——债券投资	5,692,700.00	-
——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	-179,333,792.25	26,348,765.76

7.4.7.17 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
基金赎回费收入	1,116,589.51	5,651,534.01
其　他	92,491.41	—
合计	1,209,080.92	5,651,534.01

7.4.7.18 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
交易所市场交易费用	55,596,954.71	80,577,057.25
银行间市场交易费用	6,390.00	—
合计	55,603,344.71	80,577,057.25

7.4.7.19 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2008年01月01日-2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日-2007年12月31日
审计费用	80,000.00	90,000.00
信息披露费	200,000.00	190,000.00
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
其　他	6,130.60	2,379.04
合计	304,130.60	300,379.04

7.4.8 关联方关系

如果本基金有能力直接或间接地控制及共同控制另一方或对另一方施加重大影响;或本基金与另一方或多方同受一方控制、共同控制或重大影响,均被视为关联方。关联方可为个人或其他实体。

7.4.8.1 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
东吴基金管理有限责任公司	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
中国工商银行股份有限公司	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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日-2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日-2007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	4,723,354,722.87	24.85%	6,979,678,205.11	30.80%

7.4.9.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日-2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日-2007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