

富国天博创新主题股票型证券投资基金二〇〇七年半年度报告摘要

(上接 A57 版)

(二) 会计报表附注
1. 会计政策、会计估计及其变更
本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

Table with 2 columns: 企业名称 and 与本基金的关系. Lists related companies like 富国基金管理有限公司 and their relationships.

Table with 2 columns: 关联方名称 and 2007年1月1日至2007年4月26日. Shows financial data for related parties.

Table with 2 columns: 关联方名称 and 2006年上半年度. Shows financial data for related parties for the first half of 2006.

Table with 2 columns: 关联方名称 and 2007年1月1日至2007年4月26日. Shows financial data for related parties.

Table with 2 columns: 关联方名称 and 2006年上半年度. Shows financial data for related parties for the first half of 2006.

Table with 2 columns: 关联方名称 and 2007年1月1日至2007年4月26日. Shows financial data for related parties.

Table with 2 columns: 关联方名称 and 2006年上半年度. Shows financial data for related parties for the first half of 2006.

注: a. 上述关联方已除中国证券投资基金业协会承担的有关证券承销业务的证券投资风险基金。
b. 股票交易佣金为成交金额的1%扣除证券公司应负担的费用(包括但不限于支付(卖)给手费、交(卖)证管费和证券结算风险基金等)；证券公司不向本基金收取因提供证券经纪和证券投资服务而产生的佣金，但本基金的证券经纪和证券资产管理费用从支付给该证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金的比例是公允的，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研究报告和市场信息服务。

B. 关联方报酬
1. 基金管理人报酬——基金管理费
基金管理人报酬按前一日基金资产净值的前1.5%的年费率计提，基金成立三个月后，如持有现金的比例超过资产净值的20%，超过部分不计提基金管理费。计算方法如下：

Table with 2 columns: 项目 and 期间. Shows management fees for 2007 and 2006.

注: a. 与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易
b. 与托管行进行银行间同业市场债券交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

(七) 投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况
截至2007年6月30日,富国天博创新主题股票型证券投资基金资产净值为7,200,207,948.10元,基金份额净值为1.0647元,基金份额累计净值为2.8225元。其资产组合情况如下：

Table with 2 columns: 序号 and 资产项目. Shows asset portfolio details as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held as of 6/30/2007.

(八) 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

Table with 2 columns: 项目 and 基金资产净值. Shows performance metrics for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 资产项目. Shows asset portfolio details for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

(九) 投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况
截至2007年6月30日,富国天博创新主题股票型证券投资基金资产净值为7,200,207,948.10元,基金份额净值为1.0647元,基金份额累计净值为2.8225元。其资产组合情况如下：

Table with 2 columns: 序号 and 资产项目. Shows asset portfolio details for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

Table with 2 columns: 序号 and 证券名称. Shows top 10 securities held for 2007 H1.

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2007 年半年度报告摘要

(上接 A55 版)
1. 整个报告期内买入股票的成本总额为 5,506,622,589.38 元,卖出股票的收入总额为 2,828,242,906.86 元。

(五) 期末未持有债券投资组合
(六) 投资组合报告摘要
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受到公开谴责、处罚的证券。

Table with 2 columns: 项目 and 金额. Shows investment portfolio details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

本基金份额持有人户数 158,101 户
平均每户持有基金份额 16,571.81 份

Table with 2 columns: 项目 and 份额(份). Shows fund statistics.

九、基金份额变动情况
期初生效日的基金份额总额 1,029,352,840.96
期初基金份额总额 1,131,191,938.85
期末基金份额总额 2,620,019,619.60

十、重大事件提示
(一) 本报告期末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) 基金托管人中国工商银行专门基金托管部门无重大人事变动。
(四) 基金管理人、基金资产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。
(五) 本基金报告期内本基金投资策略未改变。

(六) 本报告期内本基金收益分配事项:
本基金于 2007 年 1 月 12 日宣告向截至 2007 年 1 月 15 日止登记在册的全体持有人,按每 10 份基金份额派发红利 1.00 元人民币,红利发放日为 2007 年 1 月 18 日,共分配收益计 12,692,988.74 元人民币,其中以现金形式派发计 4,820,633.76 元人民币,以红利再投资形式派发计 7,872,324.98 元人民币。

本基金于 2007 年 4 月 6 日宣告向截至 2007 年 4 月 10 日止登记在册的全体持有人,按每 10 份基金份额派发红利 3.30 元人民币,红利发放日为 2007 年 4 月 13 日,共分配收益计 64,806,700.56 元人民币,其中以现金形式派发计 41,631,689.36 元人民币,以红利再投资形式派发计 13,175,011.20 元人民币。

(七) 本报告期内本基金更换会计师事务所。由安永大华会计师事务所有限责任公司变更为江苏公证会计师事务所有限公司。

(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。

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

(六) 2007 年 4 月 26 日按券种分类的债券投资组合
截至 2007 年 4 月 26 日,东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金资产净值为 244,296,234.15 元,基金份额净值为 1.0712 元,基金份额累计净值为 2.0712 元。其资产组合情况如下：

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

(一) 2007 年 1 月 16 日本基金管理人向中国证劵报、上海证劵报上披露《东吴基金管理有限公司更换会计师事务所的公告》,会计师事务所由安永大华会计师事务所有限责任公司变更为江苏公证会计师事务所有限公司。

(二) 2007 年 5 月 15 日本基金管理人向中国证劵报、上海证劵报上披露《关于东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金申购费用和申购份额的计算采用外扣法的公告》。

(三) 2007 年 6 月 29 日本基金管理人向中国证劵报、证劵时报、上海证劵报上披露《东吴基金管理有限公司旗下基金实施侧袋机制的公告》。

十二、备查文件目录
需披露备查文件的目录:
(一) 中国证监会批准“东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金”设立的文件
(二) 东吴嘉禾优势精选混合型开放式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) 东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金托管协议
(七) 报告期内东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金在指定报刊上各项公告的刊载存放地;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:021-50606666

东吴基金管理有限公司
2007 年 8 月 27 日

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金 2007 年半年度报告摘要

(上接 A56 版)
(五) 期末未持有债券投资组合
(六) 投资组合报告摘要
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受到公开谴责、处罚的证券。

Table with 2 columns: 项目 and 金额. Shows investment portfolio details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

注: 本基金本期及上期与托管行未进行银行间同业市场债券(回购)交易
a. 与托管行进行银行间同业市场债券(回购)交易明细如下：

Table with 2 columns: 债券交易 and 成交金额(元) / 利息收入(元) / 利息支出(元). Shows bond transaction details.

本基金份额持有人户数 206,527 户
平均每户持有基金份额 10,157.38 份

Table with 2 columns: 项目 and 份额(份). Shows fund statistics.

九、基金份额变动情况
合同生效日的基金份额总额 2,144,214,669.67
期初基金份额总额 2,144,214,669.67
期末基金份额总额 2,087,616,790.46

十、重大事件提示
(一) 本报告期末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,托管人发生变更。
(四) 基金管理人、基金资产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。
(五) 本基金报告期内本基金投资策略未改变。

(六) 本报告期内本基金收益分配事项:
本基金于 2007 年 1 月 12 日宣告向截至 2007 年 1 月 15 日止登记在册的全体持有人,按每 10 份基金份额派发红利 1.00 元人民币,红利发放日为 2007 年 1 月 18 日,共分配收益计 12,692,988.74 元人民币,其中以现金形式派发计 4,820,633.76 元人民币,以红利再投资形式派发计 7,872,324.98 元人民币。

本基金于 2007 年 4 月 6 日宣告向截至 2007 年 4 月 10 日止登记在册的全体持有人,按每 10 份基金份额派发红利 3.30 元人民币,红利发放日为 2007 年 4 月 13 日,共分配收益计 64,806,700.56 元人民币,其中以现金形式派发计 41,631,689.36 元人民币,以红利再投资形式派发计 13,175,011.20 元人民币。

(七) 本报告期内本基金更换会计师事务所。由安永大华会计师事务所有限责任公司变更为江苏公证会计师事务所有限公司。

(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。

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

Table with 2 columns: 序号 and 债券名称. Shows bond portfolio details.

(一) 2007 年 1 月 16 日本基金管理人向中国证劵报、上海证劵报上披露《东吴基金管理有限公司更换会计师事务所的公告》,会计师事务所由安永大华会计师事务所有限责任公司变更为江苏公证会计师事务所有限公司。

(二) 2007 年 5 月 15 日本基金管理人向中国证劵报、上海证劵报上披露《关于东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金申购费用和申购份额的计算采用外扣法的公告》。

(三) 2007 年 6 月 29 日本基金管理人向中国证劵报、证劵时报、上海证劵报上披露《东吴基金管理有限公司旗下基金实施侧袋机制的公告》。

十二、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刊载存放地;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:021-50606666

东吴基金管理有限公司
2007 年 8 月 27 日