

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2007 年年度报告摘要

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 累计卖出金额, 占基金资产净值(%). Lists various stocks and their trading volumes.

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占基金资产净值(%). Lists various stocks and their purchase amounts.

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占基金资产净值(%). Lists various stocks and their purchase amounts.

Table with columns: 合同生效日的基金总额(亿元), 报告期初基金份额总额(亿元), etc. Shows fund performance metrics.

十、重大事件揭示 (一) 本报告期内未召开基金份额持有人大会. (二) 基金管理人重大人事变动.

Table with columns: 第一次收益分配金额, 第二次收益分配金额, etc. Shows distribution details.

(七) 本报告期内本基金聘请会计师事务所, 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) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况 1. 报告期内租用证券公司席位进行股票、债券及回购、权证交易统计

Table with columns: 券商名称, 报告期内买入金额, 占基金资产净值比例, etc. Lists brokerage firms and their transaction volumes.

2. 本报告期内新增席位5个, 为海通证券席位、国泰君安席位、国泰君安席位、安信证券席位、安信证券席位.

3. 租用证券公司专用交易席位的标准主要包括: 证券公司基本信用评级(财务状况、资信状况、经营业绩); 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、及时性和有效性)等方面.

租用证券公司专用交易席位的程序: 首先根据租用证券公司专用交易席位的选项标准进行评价, 然后根据综合评价得分进行选择.

1. 2007年1月8日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金暂停大额申购业务的公告》.

2. 2007年1月16日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

3. 2007年2月6日、2月28日、3月12日、3月26日、4月6日, 分别在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金公告》.

4. 于2007年4月19日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金恢复大额申购公告》.

5. 2007年5月30日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金申购费率及赎回费率调整的公告》.

6. 2007年5月30日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

7. 2007年7月27日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

8. 2007年8月6日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

9. 2007年8月10日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

10. 2007年8月21日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

11. 2007年9月27日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

12. 2007年10月22日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

13. 2007年11月8日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《关于修改东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

14. 2007年11月20日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

15. 2007年11月24日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

16. 2007年11月28日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

17. 2007年12月17日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

18. 2007年12月17日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

3. 本报告期末买入股票的成本总额为 12,965,748,214.9元, 卖出股票的收入总额为 10,017,988.87元.

(五) 期末无转债持仓情况

1. 本基金本报告期的前十名重仓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. 本基金本报告期的前十名重仓证券中, 没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票.

3. 本基金期末未持有处于转股期的可转换债券

4. 期末其他资产构成情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元). Shows asset composition.

5. 本报告期末未持有权证, 期间权证交易情况如下:

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 期初持仓数量(份), 期间买入数量(份), etc.

八、基金份额持有人户数、持有人结构 截止2007年12月31日

Table with columns: 本基金份额持有人户数, 平均每户持有基金份额.

2. 基金份额持有人结构

Table with columns: 项目, 份额(份), 占总份额比例%.

3. 期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

九、基金份额变动情况

Table with columns: 基金名称, 期初基金份额(份), 期间买入份额(份), etc.

十、重大事件揭示 (一) 本报告期内未召开基金份额持有人大会. (二) 基金管理人重大人事变动.

1. 经东吴基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过, 决定聘任吴威先生担任东吴基金管理有限公司督察长职务.

2. 根据证监会的相关要求, 东吴基金管理有限公司第六次股东大会审议通过, 自2007年12月20日起徐建平先生担任东吴基金管理有限公司法定代表人, 吴威先生不再担任东吴基金管理有限公司法定代表人.

(三) 基金托管人中国农业银行专门基金托管部门重大人事变动. 1. 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.

(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) 报告期内本基金收益分配事项.

Table with columns: 首次收益分配金额, 累计收益分配金额. Shows distribution amounts.

(七) 本报告期内本基金未更换会计师事务所. (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. 报告期内租用证券公司席位进行股票、债券及回购、权证交易统计

Table with columns: 券商名称, 报告期内买入金额, 占基金资产净值比例, etc.

2. 本报告期内新增席位5个, 为海通证券席位、国泰君安席位、国泰君安席位、安信证券席位、安信证券席位.

3. 租用证券公司专用交易席位的标准主要包括: 证券公司基本信用评级(财务状况、资信状况、经营业绩); 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、及时性和有效性)等方面.

租用证券公司专用交易席位的程序: 首先根据租用证券公司专用交易席位的选项标准进行评价, 然后根据综合评价得分进行选择.

1. 2007年1月8日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金暂停大额申购业务的公告》.

2. 2007年1月16日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

3. 2007年2月6日、2月28日、3月12日、3月26日、4月6日, 分别在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金公告》.

4. 于2007年4月19日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金恢复大额申购公告》.

5. 2007年5月30日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金申购费率及赎回费率调整的公告》.

6. 2007年5月30日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

7. 2007年7月27日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

8. 2007年8月6日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

9. 2007年8月10日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

10. 2007年8月21日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

11. 2007年9月27日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

12. 2007年10月22日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

13. 2007年11月8日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《关于修改东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

14. 2007年11月20日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

15. 2007年11月24日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

16. 2007年11月28日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

17. 2007年12月17日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

18. 2007年12月17日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

十一、新修订公司章程 需报备审查文件的目的: (一) 中国证监会批准“东吴价值成长双动力股票型开放式证券投资基金”设立的文件

(二) 《东吴价值成长双动力股票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) 东吴价值成长双动力股票型开放式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开放式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

Table with columns: 存放地点, 基金管理人、基金托管人处, 投资者可以在营业时间内免费查阅, 也可按工本费购买复印件.

投资者对本报告如有任何疑问, 可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司. 客户服务电话: 021-50509666

东吴基金管理有限公司 2008年3月27日

东吴价值成长双动力股票型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 累计卖出金额, 占基金资产净值(%). Lists various stocks and their trading volumes.

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入金额, 占基金资产净值(%). Lists various stocks and their purchase amounts.

Table with columns: 债券组合名称, 债券投资, 成本占净值%, 债券市值, 市值占净值%. Shows bond portfolio details.

(六) 期末无转债持仓情况

(七) 投资组合报告附注 1. 本基金本报告期的前十名重仓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. 本基金本报告期的前十名重仓证券中, 没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票.

3. 本基金期末未持有处于转股期的可转换债券

4. 期末其他资产的构成

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元). Shows asset composition.

5. 本报告期末未持有权证, 期间权证交易情况如下:

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 期初持仓数量(份), 期间买入数量(份), etc.

八、基金份额持有人户数、持有人结构 截止2007年12月31日

Table with columns: 本基金份额持有人户数, 平均每户持有基金份额.

2. 基金份额持有人结构

Table with columns: 项目, 份额(份), 占总份额比例%.

3. 期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

九、基金份额变动情况

Table with columns: 报告期初基金份额总额(亿元), 报告期期末基金份额总额(亿元), etc.

十、重大事件揭示 (一) 本报告期内未召开基金份额持有人大会. (二) 基金管理人重大人事变动.

1. 经东吴基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过, 决定聘任吴威先生担任东吴基金管理有限公司督察长职务.

2. 根据证监会的相关要求, 东吴基金管理有限公司第六次股东大会审议通过, 自2007年12月20日起徐建平先生担任东吴基金管理有限公司法定代表人, 吴威先生不再担任东吴基金管理有限公司法定代表人.

(三) 基金托管人中国农业银行专门基金托管部门重大人事变动. 1. 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.

(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) 报告期内本基金收益分配事项.

Table with columns: 首次收益分配金额, 累计收益分配金额. Shows distribution amounts.

(七) 本报告期内本基金未更换会计师事务所. (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. 报告期内租用证券公司席位进行股票、债券及回购、权证交易统计

Table with columns: 券商名称, 报告期内买入金额, 占基金资产净值比例, etc.

2. 本报告期内新增席位5个, 为海通证券席位、国泰君安席位、国泰君安席位、安信证券席位、安信证券席位.

3. 租用证券公司专用交易席位的标准主要包括: 证券公司基本信用评级(财务状况、资信状况、经营业绩); 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、及时性和有效性)等方面.

租用证券公司专用交易席位的程序: 首先根据租用证券公司专用交易席位的选项标准进行评价, 然后根据综合评价得分进行选择.

1. 2007年1月8日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金暂停大额申购业务的公告》.

2. 2007年1月16日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

3. 2007年2月6日、2月28日、3月12日、3月26日、4月6日, 分别在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金公告》.

4. 于2007年4月19日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金恢复大额申购公告》.

5. 2007年5月30日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金申购费率及赎回费率调整的公告》.

6. 2007年5月30日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

7. 2007年7月27日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

8. 2007年8月6日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

9. 2007年8月10日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

10. 2007年8月21日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

11. 2007年9月27日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

12. 2007年10月22日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

13. 2007年11月8日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《关于修改东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

14. 2007年11月20日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

15. 2007年11月24日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

16. 2007年11月28日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

17. 2007年12月17日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

18. 2007年12月17日, 在中国证券报、上海证券报上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的公告》.

十一、新修订公司章程 需报备审查文件的目的: (一) 中国证监会批准“东吴价值成长双动力股票型开放式证券投资基金”设立的文件

(二) 《东吴价值成长双动力股票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) 东吴价值成长双动力股票型开放式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开放式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

Table with columns: 存放地点, 基金管理人、基金托管人处, 投资者可以在营业时间内免费查阅, 也可按工本费购买复印件.

投资者对本报告如有任何疑问, 可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司. 客户服务电话: 021-50509666

东吴基金管理有限公司 2008年3月27日

3. 本报告期内买入股票的成本总额为 23,129,918,906.89元, 卖出股票的成交总额为 22,894,047,745.31元.

(五) 期末按券种分类的债券投资组合