

巨田基础行业证券投资基金

2007 年半年度报告

基金管理人：巨田基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行

送出日期： 2007年8月28日

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。

基金托管人中国光大银行根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 20 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。

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。

本报告相关财务资料未经审计。

目 录

一、基金简介	1
二、主要财务指标和基金净值表现	3
三、基金管理人报告	5
四、基金托管人报告	7
五、基金半年度财务会计报告	8
六、投资组合报告	20
七、基金份额持有人户数、持有人结构	25
八、开放式基金份额变动	25
九、重大事件揭示	26
十、备查文件目录	29

一、基金简介

(一) 基金基本情况

- 1、基金名称：巨田基础行业证券投资基金
- 2、基金简称：巨田基础行业
- 3、交易代码：233001
- 4、基金运作方式：契约型开放式
- 5、基金合同生效日：2004年3月26日
- 6、报告期末基金份额总额：108,889,875.05份
- 7、基金投资目标

分享中国经济持续发展过程所带来的基础行业的稳定增长，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

本基金看好基础行业的发展前景，中长期持有以基础行业股票为主的证券投资组合，并注重资产在行业间的配置，适当进行时机选择。

8、投资策略

(1) 股票投资策略：

我们看好基础行业的稳定增长趋势，对于精选出来的个股，我们将坚持中长期持有的策略。

精选个股主要采用自下而上的方法：根据基础行业股票综合评级系统对备选库股票进行评级排序。选股的标准主要是针对基础行业特点，对上市公司进行财务状况分析、内在价值分析和相对价值分析，研究内容包括上市公司核心竞争力、持续经营能力、公司治理结构、未来经营状况和现金流、财务状况和相对价值等方面。以持续盈利和稳定增长为核心标准，对上市公司进行分行业综合评级。

根据综合评级，从中寻找出业绩优良，发展前景较好并能代表行业发展趋势、价值被低估的公司进行实地调研，最终做出投资价值分析。我国证券市场处于新兴加转轨的阶段，市场的波动性依然较大，所以我们将依据市场判断和政策分析，适当采用时机选择策略，以优化组合表现。

(2) 债券投资策略

以“类别资产配置、久期管理”为核心，通过“自上而下”的投资策略，以

长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、不同市场间的资产配置、券种选择三个层面进行投资管理；并结合使用“自下而上”的投资策略，即收益率曲线分析，久期管理，新债分析，信用分析，流动性分析等方法，实施动态投资管理，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。

（3）权证投资策略

对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险进行分析的基础之上，权证在基金的投资中将主要起到锁定收益和控制风险的作用。

以 BS 模型和二叉树模型为基础来对权证进行定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。

在组合构建和操作中运用的投资策略主要包括但不限于保护性看跌策略、抛补的认购权证、双限策略等。

9、业绩比较基准

上证综指与深证综指的复合指数×75%+中信全债指数×20%+同业存款利率×5%

其中：复合指数=（上证 A 股流通市值/A 股总流通市值）×上证综指+（深证 A 股流通市值/A 股总流通市值）×深证综指

10、风险收益特征

追求基金资产长期稳定增值，风险属于中低水平。

（二）基金管理人情况

- 1、基金管理人名称：巨田基金管理有限公司
- 2、注册地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层
- 3、办公地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层
- 4、邮政编码：518033
- 5、法定代表人：王一楠
- 6、信息披露负责人：李锦
- 7、联系电话：0755—82993636
- 8、传真：0755—82990384
- 9、电子邮箱：xxpl@jtfund.com

（三）基金托管人

- 1、基金托管人名称：中国光大银行
- 2、注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
- 3、办公地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
- 4、邮政编码：100045
- 5、法定代表人：王明权
- 6、信息披露负责人：张建春
- 7、联系电话：010—68560675
- 8、传真：010—68560661
- 9、电子邮箱：zhangjianchun@cebbank.com

（四）信息披露报刊、网站及置备地点

信息披露报纸：《证券时报》

基金管理人互联网网址：<http://www.jtfund.com>

基金半年度报告置备地点：基金管理人和基金托管人处

（五）注册登记机构情况

注册登记人：巨田基金管理有限公司

办公地址：深圳市福田区滨河大道5020号证券大厦4层

二、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标（未经审计）

主要财务指标	单位：人民币元
	2007年6月30日
1、基金本期净收益	122,897,022.25
2、加权平均基金份额本期净收益	0.9612
3、期末可供分配基金净收益	89,633,275.55
4、期末可供分配基金份额收益	0.8232
5、期末基金资产净值	198,523,150.60
6、期末基金份额净值	1.8232
7、基金加权平均净值收益率	57.87%

8、本期基金份额净值增长率	59.12%
9、基金份额累计净值增长率	130.50%

注：以上所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，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（二）基金净值表现

根据《巨田基础行业证券投资基金基金合同》，本基金的业绩比较基准计算公式为：

上证综指与深证综指的复合指数×75%+中信全债指数×20%+同业存款利率×5%；

其中：上证综指与深证综指的复合指数=（上证A股流通市值/A股总流通市值）×上证综指+（深证A股流通市值/A股总流通市值）×深证综指

基准指数的构建考虑了三个原则。

1、由于当前并不存在一个为投资者广泛接受的基础行业指数，所以以自定义方式来构建业绩比较基准，若将来出现一个能得到市场认可的基础行业指数，我们将在研究对比的基础上选择更为合理的业绩比较基准。

2、投资者认同度。选择被市场广泛认同的上证综指、深证综指、中信全债指数作为计算的基础指数，并以流通市值比例为权数对上证综指、深证综指作加权计算。

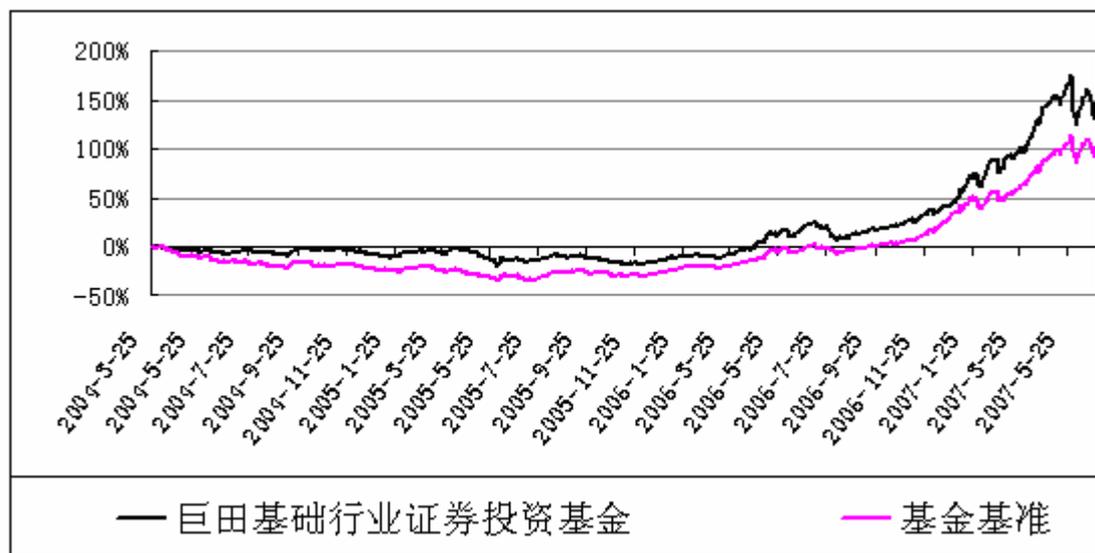
3、业绩比较的合理性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，根据基金资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照75%、20%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

A、巨田基础行业证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	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
过去一个月	-7.99%	2.86%	-5.85%	2.27%	-2.14%	0.59%
过去三个月	16.95%	2.34%	17.17%	1.85%	-0.22%	0.49%
过去六个月	59.12%	2.24%	41.93%	1.80%	17.19%	0.44%
过去一年	87.81%	1.78%	91.55%	1.43%	-3.74%	0.35%
过去三年	146.54%	1.32%	128.33%	1.20%	18.21%	0.12%
自基金成立起至今	130.51%	1.27%	91.81%	1.18%	38.70%	0.09%

B、巨田基础行业证券投资基金基金合同生效以来累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据巨田基础行业证券投资基金合同规定，本基金投资于基础行业类股票的比例不低于股票资产的 80%；股票投资比例浮动范围为基金净值的 50%—75%；债券投资比例浮动范围为基金净值的 20%—45%；现金资产比例浮动范围为基金净值的 5%—20%。截止 2007 年 6 月 30 日，本基金股票投资占基金净值的 74.19%，其中基础行业类股票的比例为股票资产的 83.75%；债券投资占基金净值的 20.82%；现金资产占基金净值的 5.93%。

三、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理小组简介

1、基金管理人简介

巨田基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]33号文批准设立。公司股东为巨田证券有限责任公司、中信国安信息产业股份有限公司、汉唐证券有限责任公司、深圳市招融投资控股有限公司、浙江中大集团控股有限公司，公司注册资本为1亿元人民币。基金管理人旗下共管理三只开放式基金，即本基金、巨田资源优选混合型证券投资基金和巨田货币市场基金。本基金是基金管理人管理的第一只基金。

2、基金经理简介

陈守红先生，中南财经政法大学金融学博士、金融学硕士、经济学学士，深圳金融学会理事，10年证券从业经验。曾服务于光大证券、平安证券、兴业基金，

历任光大证券高级经理、平安证券综合研究所副所长、兴业基金研究总监。2003年被《新财富》评为“水、电、煤”行业全国最佳分析师。

（二）基金运作合法合规性声明

报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及相关法律法规、《巨田基础行业证券投资基金基金合同》的规定，以为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报作为目标，勤勉尽责地管理和运用基金资产，没有损害基金份额持有人利益的行为。

基金管理人自成立以来，稳健经营，规范运作。基金管理人股东汉唐证券有限责任公司于2005年6月被行政关闭现处于清算过程中，巨田证券有限责任公司于2006年10月被行政清理。对此基金管理人高度重视，正与有关各方进行积极有效的沟通，争取尽快完成股权重组，为实现长期稳定发展创造更为良好的条件。

（三）基金经理工作报告及展望

一、上半年回顾

股指在整个2007年上半年时间内基本上都是处于爬升过程。上证综指6月30日收3820.70点，较2006年末上涨42.8%，在半年内收出一根实体达1092.51点的大阳线，无论涨幅还是成交量均创出历史新高。从市场个股表现看，一季度基本是二、三线股的天下的天下，几乎所有低价股都出现了大幅涨升，而基金重仓的蓝筹股则表现不佳，从而也在市场中引发了是否存在泡沫以及投资与投机之争。而在二季度尤其二季度末，市场格局出现较大变化。尽管二季度上证综指依然收出实体为624.11点的季度阳线，但该季度阳线留有长达515.26的上影线，显示市场的明显分歧。前期表现出色的题材股、低价股、ST股等出现整体性回调，相当多股票的股价在短短一个月内甚至被腰斩，而以基金重仓股为代表的蓝筹股则表现相对稳健，银行、保险、钢铁、有色、地产等板块整体表现出了很好的抗跌性，从而也以生动实例对市场进行了一次风险教育与价值投资教育。

政策上看，二季度在政策面上相对“富余”。央行“三率齐动”、财政部调整交易印花税都在5月实施，发行特别国债也在6月基本确定，取消利息税与加息是市场担心的另外两个可能的政策变量。其中已经确定的发行特别国债对市场影响更大一些。市场担心特别国债大量发行会严重影响市场流动性，从而一定程度

上动摇整个牛市的根基。另外，IPO 的明显加速以及 QDII 的实施等都对市场资金供给产生了一定消极影响，这些因素在 6 月引致指数大幅波动。6 月上证综指下跌 288.95 点，跌幅为 7.03%，整体表现在全球股市 6 月的排位中也属最末之一。

本基金上半年严格遵守基金合同规定，主要增持了煤炭与水电等基础行业个股，适当减持了航运类个股。同时积极利用基金合同规定的非基础行业投资比例，对相关非基础行业公司做了比较深入的挖掘，取得了相对不错的投资效果。

二、未来展望

展望未来，本基金认为 GDP 继续保持稳定快速增长、人民币币值稳中有升、市场流动性继续保持充溢这些支撑牛市的根基没有发生任何变化，因此未来在战略上继续保持看多做多是唯一选择。

战术上，我们认为需要注意一些影响市场的短期变量，主要包括后续宏观紧缩调控措施诸如加息的可能性与力度，微观企业效益变化尤其上市公司群体的效益变化引致的估值水平变化等等。我们认为短期大盘有调整需要，适当降低总体仓位水平，以防守姿态应对未来的调整是必要的。但这种调整应该视作为牛市过程中的中继调整，不会影响牛市进程。

未来操作上，本基金将密切关注以下几类公司的投资机会：一是受益人民币升值而有重估需要的行业，包括地产、以银行信托为代表的金融行业、以航空、海运为代表的交运行业等；二是有外延增长的公司，主要是有资产注入与有整体上市潜力的公司，其中我们会重点关注那些在股改中有明确注资承诺的公司，以及母公司实力强大的央企；三是具备明显估值比较优势的行业，如钢铁、有色、煤炭、工程机械等。本基金将一如既往严格遵循基础行业基金合同，力争为持有人获取长期稳定收益。

四、基金托管人报告

中国光大银行根据《证券投资基金法》及相关法规、《巨田基础行业证券投资基金基金合同》和《巨田基础行业证券投资基金托管协议》，托管巨田基础行业证券投资基金（以下简称巨田基础行业基金）。

2007年上半年，中国光大银行在巨田基础行业基金托管过程中，严格遵守了

《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及相关实施准则、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金的全部资产，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为托管人所应尽的义务。

2007年上半年，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及相关实施准则、基金合同、托管协议和其他有关规定，对基金管理人——巨田基金管理有限公司进行了监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金严格遵守《基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作中严格遵守了基金合同的规定。

本托管人依法对基金管理人——巨田基金管理有限公司编制的“巨田基础行业证券投资基金2007年半年度报告”进行了审核，报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

五、基金半年度财务会计报告（未经审计）

（一）基金会计报表

1、巨田基础行业证券投资基金资产负债表

单位：人民币元

资产：	附注	2007年6月30日	2006年12月31日
银行存款	5(5)	8,973,838.24	8,654,374.85
清算备付金		2,801,685.02	627,367.80
交易保证金		1,000,000.00	1,250,000.00
应收证券清算款		1,626,134.69	461,269.49
应收股利		90,576.00	—
应收利息	6(1)	752,172.28	392,549.96
应收申购款		139,434.97	2,000.00
股票投资市值		147,290,806.13	120,261,086.92
其中：股票投资成本		142,296,847.07	84,600,575.70
债券投资市值		41,342,172.50	33,294,875.00
其中：债券投资成本		41,278,767.67	33,247,594.52
权证投资		—	—
其中：权证投资成本		—	—

资产总计		204,016,819.83	164,943,524.02
负债：			
应付证券清算款		2,061,878.01	—
应付赎回款		1,638,139.31	1,067,076.46
应付赎回费		2,492.67	270.60
应付管理人报酬		271,272.26	218,612.93
应付托管费		45,212.04	36,435.46
应付佣金	6(3)	646,886.61	302,808.87
其他应付款	6(4)	744,020.06	993,960.06
预提费用	6(5)	83,768.27	160,000.00
负债合计		5,493,669.23	2,779,164.38
持有人权益：			
实收基金	6(6)	108,889,875.05	141,526,248.41
未实现利得(亏损)	6(7)	-35,834,867.65	-9,875,876.91
未分配收益		125,468,143.20	30,513,988.14
持有人权益合计		198,523,150.60	162,164,359.64
负债及持有人权益总计		204,016,819.83	164,943,524.02
基金份额净值		1.8232	1.1458

所附注释系会计报表的组成部分

2、巨田基础行业证券投资基金经营业绩表

单位：人民币元

项目	附注	2007.01.01-06.30	2006.01.01-06.30
一、收入			
股票差价收入	6(8)	122,689,887.43	100,560,625.21
债券差价收入	6(9)	-49,288.03	2,404,149.22
权证差价收入	6(10)	743,135.84	9,806,832.70
债券利息收入		532,393.91	1,585,941.01
存款利息收入		91,744.50	155,981.09
股利收入		972,843.56	3,848,672.08
买入返售证券收入		—	—
其他收入	6(11)	179,086.23	75,923.73
收入合计		125,159,803.44	118,438,125.04
二、费用			
基金管理人报酬	5(2)	1,581,445.60	5,110,223.10
基金托管费	5(2)	263,574.30	851,703.83
卖出回购证券支出		318,789.42	10,993.97
其他费用	6(12)	98,971.87	159,597.29
其中：信息披露费		49,588.57	99,177.14
审计费用		29,752.78	49,588.57

费用合计		2,262,781.19	6,132,518.19
三、基金净收益		122,897,022.25	112,305,606.85
加:未实现利得(亏损)		-30,650,427.81	110,107,843.41
四、基金经营业绩		92,246,594.44	222,413,450.26

所附注释系会计报表的组成部分

3、巨田基础行业证券投资基金净值变动表

单位：人民币元

	附注	2007.01.01-06.30	2006.01.01-06.30
一、期初基金净值		162,164,359.64	926,322,376.31
二、本期经营活动：			
基金净收益		122,897,022.25	112,305,606.85
未实现利得(亏损)		-30,650,427.81	110,107,843.41
经营活动产生的基金净值变动数		92,246,594.44	222,413,450.26
三、本期基金份额交易：			
基金申购款		116,042,926.56	19,639,726.92
基金赎回款		171,930,730.04	781,607,850.94
基金份额交易产生的基金净值变动数		-55,887,803.48	-761,968,124.02
四、本期向持有人分配收益			22,290,912.06
五、期末基金净值		198,523,150.60	364,476,790.49

所附注释系会计报表的组成部分

4、巨田基础行业证券投资基金收益分配表

单位：人民币元

	附注	2007.01.01-06.30	2006.01.01-06.30
本期基金净收益(亏损)		122,897,022.25	112,305,606.85
加:期初基金净收益		30,513,988.14	-126,094,674.08
本期损益平准金		-27,942,867.19	57,760,913.90
可供分配基金净收益		125,468,143.20	43,971,846.67
减:本期已分配基金净收益		—	22,290,912.06
期末基金净收益		125,468,143.20	21,680,934.61

所附注释系会计报表的组成部分

(二) 基金会计报表附注(除特别表明外金额单位为人民币元)

附注 1. 基金简介

巨田基础行业证券投资基金(以下简称“本基金”)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]第11号《关于同意巨田基础行业证券投资基金设立的批复》核准,由巨田基金管理有限公司依照《证券投资基金

管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《巨田基础行业证券投资基金基金契约》(后更名为《巨田基础行业证券投资基金基金合同》)发起,并于2004年3月26日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,854,428,324.58元,业经深圳天健信德会计师事务所信德验资字(2004)第8号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为巨田基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《巨田基础行业证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金的投资组合范围为:股票投资占基金净值的50%-75%;债券投资占基金净值的20%-45%;现金资产占基金净值的5%-20%。其中投资于基础行业类股票的比例不低于股票资产的80%。

附注 2. 重要会计政策和会计估计的说明

(1) 会计制度

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《巨田基础行业证券投资基金基金合同》及中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

(2) 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年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。

(3) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(4) 记账基础及计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外,所有报表项目均以历史成本计价。

(5) 基金资产的估值原则

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值

日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

(iii) 权证投资

从获赠确认日起到卖出成交日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(iv) 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

(v) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应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价格估值。

(6) 证券投资的成本计价方法

(i) 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。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施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。

(ii) 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；买入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。

买入贴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。

(iii) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

(7) 待摊费用

待摊费用按直线法在实际受益期限内逐日摊销。

(8) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

(9) 未实现利得

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(10) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基金净损失)。

(11) 收入确认和计量

股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)

按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其相关费用的差额确认。

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适用情况下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。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

(12) 费用确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

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。

(13) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。在符合基金分配条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，且收益分配比例不低于当年基金净收益的 90%。基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

附注 3. 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b)基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征营业税和企业所得税。

(c)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，自 2005 年 6 月 13 日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%(此前按 100%)计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d)基金买卖股票于 2005 年 1 月 24 日前按照 0.2%的税率缴纳股票交易印花税，自 2005 年 1 月 24 日起减按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，自 2007 年 5 月 30 日起按 0.3%的税率缴纳股票交易印花税。

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

附注 4. 基金资产负债表日后事项（无）

附注 5. 重大关联方关系及其交易

1、关联方关系明细项目列示如下：

关联方名称	关联关系
中国光大银行	基金托管人、基金销售机构
巨田基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记人
巨田证券有限责任公司	基金管理人的股东
中信国安信息产业股份有限公司	基金管理人的股东
汉唐证券有限责任公司	基金管理人的股东
深圳市招融投资控股有限公司	基金管理人的股东
浙江中大集团控股有限公司	基金管理人的股东

2、关联方交易

本报告期发生的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款订立。

(1) 通过关联方席位进行的交易

本报告期本基金通过该等专用席位进行股票交易情况列示如下：

2007.01.01—06.30						
关联方名称	本期成交金额		占成交总金额比例	本期应支付的交易佣金		占本期佣金总金额比例
巨田证券	RMB	35,093,247.32	2.78%	RMB	27,460.67	2.69%
2006.01.01—06.30						
关联方名称	本期成交金额		占成交总金额比例	本期应支付的		占本期佣金

		金额比例	交易佣金	总金额比例
巨田证券	RMB	402,719,288.94	20.56%	RMB
				315,132.15
				19.94%

本报告期本基金通过该等专用席位进行债券和回购交易情况列示如下：

2007.01.01—06.30					
关联方名称	本期债券成交金额	占成交总金额比例	本期回购成交金额	占成交总金额比例	
巨田证券	RMB	-	-	RMB	-
2006.01.01—06.30					
关联方名称	本期债券成交金额	占成交总金额比例	关联方名称	占成交总金额比例	
巨田证券	RMB	32,918,729.02	23.82%	RMB	-
					-

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(2) 关联方报酬

基金管理人报酬按前一日的基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提，按月支付。每日应支付的基金管理人报酬=前一日基金资产净值的 1.5%/当年度的天数。

基金托管费按前一日的基金资产净值的 2.5‰的年费率逐日计提，按月支付。每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值的 2.5‰/当年度的天数。

本基金本期需支付巨田基金管理有限公司和中国光大银行的基金管理人报酬和基金托管费明细列示如下：

项目	2007.01.01—06.30	2006.01.01—06.30
基金管理人报酬	RMB 1,581,445.60	5,110,223.10
基金托管费	RMB 263,574.30	851,703.83

(3) 本基金关联方期末持有本基金份额情况

本基金关联方本报告期末未持有本基金的份额。

上年度可比期间本基金管理人持有本基金份额 10,029,225.03 份，已经于本报告期全部赎回。

(4) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，并按银行间同业利率计息。具体情况如下：

	2007年6月30日	2006年6月30日
期末银行存款余额	8,973,838.24	25,987,179.11
其中：活期存款	8,973,838.24	25,987,179.11
定期存款	—	—
存款利息收入	73,438.07	137,064.48

(6) 关联方往来款项余额

项目	关联方名称	2007年6月30日		2006年6月30日	
		金额	占该账项总金额的比例	金额	占该账项总金额的比例
应付佣金	巨田证券	27,460.67	4.25%	243,158.70	29.79%
其他应付款	巨田证券	250,000.00	33.60%	250,000.00	28.23%

附注 6. 基金会计报表重要项目注释（截至 2007 年 6 月 30 日）**(1) 应收利息**

序号	项目	余额
1	应收银行存款利息	7,079.48
2	应收清算备付金利息	1,134.72
3	应收权证保证金利息	202.50
4	应收债券利息	743,735.92
5	应收基金申购款利息	19.66
合计		752,172.28

(2) 投资估值增值

序号	项目	余额
1	股票投资估值增值	4,993,959.06
2	债券投资估值增值	63,404.83
合计		5,057,363.89

(3) 应付佣金

序号	证券公司	余额
1	巨田证券	27,460.67
2	申银万国	65,247.48
3	平安证券	51,494.20
4	联讯证券	63,254.61

5	东吴证券	54,030.08
6	国泰君安	100,525.92
7	齐鲁证券	48,370.23
8	山西证券	54,607.80
9	海通证券	36,947.33
10	长江证券	57,434.96
11	国海证券	87,513.33
合计		646,886.61

(4) 其他应付款

序号	项目	余额
1	巨田证券代付交易保证金	250,000.00
2	应付金融债税金	108,010.95
3	国海证券代付交易保证金	250,000.00
4	应付可转债税金	135,434.16
5	回购交易费	249.95
6	银行间债券交易费	325.00
合计		744,020.06

(5) 预提费用

序号	项目	余额
1	审计费	29,752.78
2	信息披露费	49,588.57
3	债券帐户维护费	4,426.92
合计		83,768.27

(6) 实收基金

序号	项目	余额
1	实收基金期初数	141,526,248.41
2	本期申购增加数	66,445,330.24
3	本期赎回减少数	99,081,703.60
4	实收基金期末数	108,889,875.05

(7) 未实现利得

序号	项目	余额
1	投资估值增值	5,057,363.89
2	本期申购的未实现利得平准金	-43,914,697.73
3	本期赎回的未实现利得平准金	3,022,466.19
合计		-35,834,867.65

(8) 股票差价收入

序号	项目	金额
1	卖出股票成交总额	666,884,128.49
2	减：卖出股票投资成本	543,633,738.75

3	减：应付佣金	560,502.31
4	股票差价收入合计	122,689,887.43

(9) 债券差价收入

序号	项目	金额
1	卖出债券成交总额	44,491,757.27
2	减：卖出债券投资成本	43,753,445.40
3	减：应收利息总额	787,599.90
4	债券差价收入合计	-49,288.03

(10) 权证差价收入

序号	项目	金额
1	卖出权证成交总额	4,988,776.69
2	减：卖出权证投资成本	4,245,640.85
3	减：应付佣金	-
4	权证差价收入合计	743,135.84

(11) 其他收入

序号	项目	金额
1	赎回费收入	179,086.23
合计		179,086.23

(12) 其他费用

序号	项目	金额
1	审计费用	29,752.78
2	信息披露费用	49,588.57
3	回购交易费用	1,142.50
4	银行手续费	4,151.10
5	债券帐户维护费	14,336.92
合计		98,971.87

附注 7. 期末流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止因申购新股中签而流通受限制的股票情况如下：

股票名称	数量（股）	总成本（元）	总市值（元）	估值方法	受限原因	受限期限
沃尔核材	2,280	35,841.60	111,378.00	按市价	网下申购中签 新股未上市	新股上市后 3 个月
东南网架	2,813	27,004.80	65,374.12	按市价	网下申购中签 新股未上市	新股上市后 3 个月
N 拓 邦	2,477	25,958.96	148,620.00	按市价	网下申购中签 新股未上市	新股上市后 3 个月

交通银行	101,160	799,164.00	1,111,748.40	按市价	网下申购中签 新股未上市	新股上市后 3个月
中国远洋	37,450	317,576.00	683,837.00	按市价	网下申购中签 新股未上市	新股上市后 3个月
合计		1,205,545.36	2,120,957.52			

六、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

资产名称	金额(元)	占基金资产总值比例
股票	147,290,806.13	72.20%
债券	41,342,172.50	20.26%
权证	-	-
银行存款及清算备付金合计	11,775,523.26	5.77%
其他资产	3,608,317.94	1.77%
基金资产总计	204,016,819.83	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业分类	期末股票市值(元)	占净值比例
A 农、林、牧、渔业	-	-
B 采掘业	14,082,771.00	7.09%
C 制造业	6,321,881.00	3.18%
C0 食品、饮料	-	-
C1 纺织、服装、皮毛	-	-
C2 木材、家具	-	-
C3 造纸、印刷	-	-
C4 石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5 电子	148,620.00	0.07%
C6 金属、非金属	-	-
C7 机械、设备、仪表	589,383.00	0.30%
C8 医药、生物制品	5,472,500.00	2.76%
C99 其他制造业	111,378.00	0.06%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	18,516,618.95	9.33%
E 建筑业	65,374.12	0.03%
F 交通运输、仓储业	79,437,889.69	40.01%
G 信息技术业	-	-
H 批发和零售贸易	-	-
I 金融、保险业	2,435,998.40	1.23%
J 房地产业	12,359,672.97	6.23%
K 社会服务业	14,070,600.00	7.09%

L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	-	-
合计	147,290,806.13	74.19%

(三) 报告期末基金投资股票明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量 (股)	期末市值(元)	市值占净值比例
1	600026	中海发展	842,000	19,349,160.00	9.75%
2	600896	中海海盛	1,258,000	17,372,980.00	8.75%
3	600900	长江电力	700,000	10,584,000.00	5.33%
4	600004	白云机场	420,000	7,812,000.00	3.94%
5	600396	金山股份	378,715	7,775,018.95	3.92%
6	600008	首创股份	660,000	7,530,600.00	3.79%
7	601006	大秦铁路	480,000	7,267,200.00	3.66%
8	600125	铁龙物流	637,043	7,026,584.29	3.54%
9	000088	盐田港	399,960	6,715,328.40	3.38%
10	600236	桂冠电力	600,000	6,540,000.00	3.29%
11	600087	南京水运	500,000	6,500,000.00	3.27%
12	600325	华发股份	200,009	6,066,272.97	3.06%
13	000623	吉林敖东	110,000	5,472,500.00	2.76%
14	000968	煤气化	500,000	4,830,000.00	2.43%
15	600675	中华企业	200,000	4,542,000.00	2.29%
16	600028	中国石化	300,000	3,966,000.00	2.00%
17	000933	神火股份	100,000	2,811,000.00	1.42%
18	000983	西山煤电	87,700	2,475,771.00	1.25%
19	600428	中远航运	110,000	2,407,900.00	1.21%
20	600029	南方航空	280,000	2,402,400.00	1.21%
21	600009	上海机场	50,000	1,900,500.00	0.96%
22	600748	上实发展	90,000	1,751,400.00	0.88%
23	600030	中信证券	25,000	1,324,250.00	0.67%
24	601328	交通银行	101,160	1,111,748.40	0.56%
25	601919	中国远洋	37,450	683,837.00	0.34%
26	002123	荣信股份	7,101	589,383.00	0.30%
27	000690	宝新能源	10,000	157,600.00	0.08%
28	002139	N 拓邦	2,477	148,620.00	0.07%
29	002130	沃尔核材	2,280	111,378.00	0.06%
30	002135	东南网架	2,813	65,374.12	0.03%
合计				147,290,806.13	74.19%

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动情况

1、累计买入金额占期初净值比例超过2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额 (元)	占期初净值比 例
1	600900	长江电力	34,494,402.62	21.27%
2	600026	中海发展	27,990,090.33	17.26%
3	600030	中信证券	25,385,809.77	15.65%
4	600028	中国石化	20,020,454.90	12.35%
5	600087	南京水运	16,500,564.10	10.18%
6	600675	中华企业	16,312,620.11	10.06%
7	600016	民生银行	15,471,001.43	9.54%
8	600325	华发股份	15,299,800.85	9.43%
9	600000	浦发银行	14,780,006.63	9.11%
10	000507	粤富华	14,021,337.85	8.65%
11	000623	吉林敖东	13,200,031.39	8.14%
12	000973	佛塑股份	13,026,685.35	8.03%
13	600993	马应龙	12,633,636.17	7.79%
14	600500	中化国际	12,266,775.32	7.56%
15	600323	南海发展	12,025,882.30	7.42%
16	600795	国电电力	11,267,022.94	6.95%
17	600428	中远航运	10,987,663.98	6.78%
18	600008	首创股份	9,691,671.27	5.98%
19	600396	金山股份	9,235,654.41	5.70%
20	600236	桂冠电力	9,168,228.31	5.65%
21	600990	四创电子	8,901,881.96	5.49%
22	600748	上实发展	8,855,409.27	5.46%
23	601628	中国人寿	8,227,387.58	5.07%
24	600688	S上石化	8,188,643.97	5.05%
25	600570	恒生电子	7,859,149.76	4.85%
26	600125	铁龙物流	7,817,232.05	4.82%
27	000088	盐田港	7,588,081.04	4.68%
28	600004	白云机场	7,422,259.78	4.58%
29	000510	金路集团	7,050,638.62	4.35%
30	600290	华仪电气	7,022,091.53	4.33%
31	000968	煤气化	6,998,851.61	4.32%
32	000858	五粮液	6,706,259.82	4.14%
33	000785	武汉中商	6,629,898.51	4.09%
34	000520	长航凤凰	6,547,432.93	4.04%
35	601006	大秦铁路	6,020,091.77	3.71%
36	000002	万科A	5,962,656.47	3.68%
37	600131	岷江水电	5,868,197.34	3.62%
38	600896	中海海盛	5,836,142.19	3.60%
39	000667	名流置业	5,776,892.83	3.56%
40	000929	兰州黄河	5,773,521.11	3.56%
41	600029	南方航空	5,569,950.40	3.43%

42	600879	火箭股份	5,357,992.12	3.30%
43	600219	南山铝业	5,289,211.97	3.26%
44	000006	深振业A	5,202,885.14	3.21%
45	600230	沧州大化	4,837,415.24	2.98%
46	600872	中炬高新	4,751,526.55	2.93%
47	600393	东华实业	4,512,254.09	2.78%
48	600301	南化股份	4,508,148.68	2.78%
49	600810	神马实业	4,505,838.99	2.78%
50	000027	深能源A	4,075,621.07	2.51%
51	000960	锡业股份	3,925,592.62	2.42%
52	600011	华能国际	3,383,560.30	2.09%

2、累计卖出金额占期初净值比例超过2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初净值比例
1	600900	长江电力	37,303,310.77	23.00%
2	600028	中国石化	26,455,987.30	16.31%
3	600030	中信证券	25,835,062.38	15.93%
4	000690	宝新能源	20,693,836.92	12.76%
5	600675	中华企业	19,086,130.86	11.77%
6	000507	粤富华	18,730,355.58	11.55%
7	000973	佛塑股份	18,209,704.43	11.23%
8	600570	恒生电子	17,961,222.35	11.08%
9	600787	中储股份	17,896,751.01	11.04%
10	600795	国电电力	16,948,362.64	10.45%
11	600016	民生银行	16,831,503.21	10.38%
12	600000	浦发银行	15,897,669.10	9.80%
13	600896	中海海盛	14,976,150.49	9.24%
14	600993	马应龙	14,802,383.40	9.13%
15	601006	大秦铁路	14,631,522.84	9.02%
16	600428	中远航运	13,796,350.74	8.51%
17	600325	华发股份	12,962,300.61	7.99%
18	600269	赣粤高速	12,423,100.61	7.66%
19	600500	中化国际	12,062,271.81	7.44%
20	600323	南海发展	11,384,895.24	7.02%
21	600026	中海发展	11,165,938.57	6.89%
22	000027	深能源A	10,933,535.93	6.74%
23	600036	招商银行	9,619,829.88	5.93%
24	601628	中国人寿	9,455,304.59	5.83%
25	600990	四创电子	9,425,587.63	5.81%
26	600087	南京水运	9,365,606.01	5.78%
27	000520	长航凤凰	8,792,678.62	5.42%

28	600688	S 上石化	8,678,813.55	5.35%
29	000510	金路集团	8,493,024.06	5.24%
30	000667	名流置业	7,647,332.65	4.72%
31	600748	上实发展	7,333,805.13	4.52%
32	000858	五 粮 液	6,818,447.87	4.20%
33	000089	深圳机场	6,688,314.97	4.12%
34	600879	火箭股份	6,674,312.21	4.12%
35	000623	吉林敖东	6,563,934.25	4.05%
36	600290	华仪电气	6,456,923.78	3.98%
37	600219	南山铝业	6,403,376.75	3.95%
38	600230	沧州大化	6,182,637.92	3.81%
39	000002	万 科 A	6,177,382.08	3.81%
40	000006	深振业 A	5,365,495.25	3.31%
41	600872	中炬高新	5,200,925.06	3.21%
42	000785	武汉中商	5,107,495.91	3.15%
43	600810	神马实业	4,989,601.28	3.08%
44	600131	岷江水电	4,959,355.28	3.06%
45	600393	东华实业	4,724,149.59	2.91%
46	000929	兰州黄河	3,954,152.08	2.44%
47	000999	S 三 九	3,852,631.20	2.38%
48	000960	锡业股份	3,823,346.32	2.36%
49	600011	华能国际	3,601,967.47	2.22%
50	600301	南化股份	3,319,413.49	2.05%
51	002082	栋梁新材	3,312,892.77	2.04%
52	000975	S 科学城	3,294,815.73	2.03%
53	600029	南方航空	3,284,019.76	2.03%

3、报告期内买入股票的成本总额为 601,330,010.12 元，卖出股票的收入总额为 666,884,128.49 元。

(五) 报告期末债券投资组合

券种	期末市值（元）	市值占净值比例
国债	41,062,400.00	20.68%
可转债	279,772.50	0.14%
合计	41,342,172.50	20.82%

(六) 报告期末基金投资前五名债券明细

债券名称	期末市值（元）	市值占净值比例
02 国债(14)	41,062,400.00	20.68%
锡业转债	279,772.50	0.14%

(七) 投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体并没有被监管部门立案调查，

也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票均在基金合同规定备选股票库之内。

3、其他资产的构成

序号	资产科目名称	金额（元）
1	交易保证金	1,000,000.00
2	应收股利	90,576.00
3	应收利息	752,172.28
4	应收申购款	139,434.97
5	证券清算款	1,626,134.69
合计		3,608,317.94

4、本期末无处于转股期的可转换债券

5、报告期主动投资的权证明细

序号	权证代码	权证名称	获得权证数量（份）	成本总额（元）
1	580007	长电 CWB1	600,000	4,416,970.55
2	580003	邯钢 JTB1	100,000	360,727.95
3	030002	五粮 YGC1	87,000	1,676,427.62

其中，邯钢 JTB1 权证和五粮 YGC1 本报告期内已全部卖出；长电 CWB1 权证本报告期内卖出 300,000 份，行权 300,000 份。

七、基金份额持有人户数、持有人结构

截至 2007 年 6 月 30 日本基金基金份额持有人户数、持有人结构如下：

- 1、基金份额持有人户数：3,917 户
- 2、平均每户持有基金份额：27,799.30 份
- 3、机构投资者持有的基金份额为 18,501,852.46 份，占总份额的 16.99%
- 4、个人投资者持有的基金份额为 90,388,022.59 份，占总份额的 83.01%

八、开放式基金份额变动

1、基金合同生效日的基金份额总额：1,854,893,478.59 份

2、本报告期内基金份额的变动情况

(1) 报告期期初基金份额总额：141,526,248.41 份

(2) 报告期期末基金份额总额：108,889,875.05 份

(3) 报告期间基金总申购份额：66,445,330.24 份

(4) 报告期间基金总赎回份额：99,081,703.60 份

九、重大事件揭示

(一) 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

(二) 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

报告期内基金管理人和基金托管人未发生重大人事变动。

(三) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内没有涉及到基金管理人、基金托管人和基金财产的诉讼。

(四) 基金投资策略的改变

报告期内本基金未改变投资策略。

(五) 基金收益分配事项

报告期内本基金未有分配收益事项。

(六) 报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

(七) 基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

1、股票交易及佣金情况（2007年1月1日—6月30日）

证券公司简称	席位数量	买卖股票成交量		实付佣金	
		成交金额 (人民币元)	占本期成交量比例	佣金 (人民币元)	占实付佣金总额的比例
巨田证券	2	35,093,247.32	2.78%	27,460.67	2.69%
申银万国	1	98,428,631.55	7.80%	80,360.41	7.88%
平安证券	1	202,123,043.92	16.02%	165,591.70	16.24%
联讯证券	1	95,198,419.63	7.55%	78,048.62	7.65%
东吴证券	1	66,148,250.41	5.24%	54,030.08	5.30%
国泰君安	1	137,683,010.58	10.91%	112,431.72	11.03%
齐鲁证券	1	155,458,223.64	12.32%	121,647.59	11.93%
山西证券	1	72,723,328.65	5.76%	59,613.85	5.85%
海通证券	1	56,264,728.83	4.46%	46,134.25	4.52%
长江证券	1	181,065,672.62	14.35%	148,058.25	14.52%

国海证券	1	161,386,416.78	12.79%	126,286.29	12.39%
光大证券	1	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-
合计	14	1,261,572,973.93	100.00%	1,019,663.43	100.00%

2、债券及回购交易情况（2007年1月1日—6月30日）

证券公司简称	席位数量	买卖债券成交量		债券回购成交量	
		成交金额 (人民币元)	占本期成交量比例	成交金额 (人民币元)	占本期成交量比例
巨田证券	2	-	-	-	-
申银万国	1	34,577,947.10	45.91%	-	-
平安证券	1	14,813,033.10	19.67%	-	-
联讯证券	1	1,402,910.10	1.86%	-	-
东吴证券	1	-	-	42,200,000.00	24.36%
国泰君安	1	11,568,334.30	15.36%	70,000,000.00	40.42%
齐鲁证券	1	-	-	-	-
山西证券	1	1,807,359.00	2.40%	-	-
海通证券	1	301,200.00	0.40%	-	-
长江证券	1	10,841,584.10	14.40%	61,000,000.00	35.22%
国海证券	1	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-
合计	14	75,312,367.70	100.00%	173,200,000.00	100.00%

3、权证交易情况

券商简称	席位数量	权证交易金额	占成交总额比例
巨田证券	2	-	-
申银万国	1	2,530,175.21	19.39%
平安证券	1	3,243,353.10	24.86%
联讯证券	1	-	-
东吴证券	1	-	-
国泰君安	1	-	-
齐鲁证券	1	-	-
山西证券	1	336,400.00	2.58%
海通证券	1	1,605,000.00	12.30%
长江证券	1	1,533,975.20	11.76%
湘财证券	1	-	-
国海证券	1	3,798,895.90	29.12%
光大证券	1	-	-
合计	14	13,047,799.41	100.00%

4、席位的变更情况

本基金在报告期内租用券商席位未有变更。

(九) 基金管理人工投资证券投资基金情况

截至 2007 年 6 月 30 日, 基金管理人工投资本基金人数为 4 人, 投资总份额 37367.42 份, 占本基金总份额比例为 0.03%。

(十) 报告期内发生的其他重要事项

序号	其他重要事项	信息披露报刊	披露时间
1	关于调整最低赎回份额的公告	《上海证券报》、 《证券时报》	2007 年 1 月 17 日
2	关于旗下基金在中信建投证券有限责任公司开展网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》	2007 年 2 月 7 日
3	关于旗下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》	2007 年 3 月 26 日
4	关于旗下基金在广发证券股份有限公司开展网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》	2007 年 4 月 24 日
5	关于旗下基金申购费率优惠活动截止的公告	《上海证券报》、 《证券时报》	2007 年 4 月 28 日
6	关于巨田基础行业证券投资基金申购费用及申购份额的计算采用外扣法的公告	《证券时报》	2007 年 5 月 18 日
7	关于网上交易系统开通中国建设银行网上支付的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》和 《证券时报》	2007 年 5 月 22 日
8	关于赎回旗下巨田基础行业证券投资基金和巨田资源优选混合型证券投资基金份额的公告	《上海证券报》和 《证券时报》	2007 年 5 月 26 日

十、备查文件目录

（一）备查文件清单

- 1、中国证监会核准巨田基础行业证券投资基金募集的文件；
- 2、《巨田基础行业证券投资基金基金合同》；
- 3、《巨田基础行业证券投资基金托管协议》；
- 4、《巨田基础行业证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

（二）存放地点及查阅方式

上述文件原件在基金管理人的办公场所存放，供投资者查阅；基金投资者也可通过基金管理人的网站(www.jtfund.com)查阅。

巨田基金管理有限公司
二〇〇七年八月二十八日