

巨田资源优选混合型证券投资基金

2006 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： 2006年8月24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 2006 年 8 月 14 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。

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	8
五、基金半年度财务会计报告	9
六、投资组合报告	23
七、基金份额持有人户数、持有人结构	27
八、开放式基金份额变动	27
九、重大事件揭示	28
十、备查文件目录	30

一、基金简介

（一）基金基本情况

- 1、基金名称：巨田资源优选混合型证券投资基金
- 2、基金简称：巨田资源
- 3、交易代码：163302
- 4、基金运作方式：上市契约型开放式
- 5、基金合同生效日：2005年9月27日
- 6、报告期末基金份额总额：84,896,899.68份
- 7、基金投资目标：

将中国资源的经济价值转换为持续的投资收益，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。

8、投资策略：

本基金将中长期持有以资源类股票为主的股票投资组合，并注重资产在资源类各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”为主、结合“自下而上”的投资方法，将资产管理策略体现在资产配置、行业配置、股票及债券选择的过程中。

（1）股票投资策略

A、根据资源的经济发展价值，注重对资源类上市公司所拥有的资源价值评估和公司证券价值的估值分析；对于精选个股将坚持中长期持有为主的策略。

B、我国证券市场处于新兴加转轨的阶段，市场的波动性较强，所以本基金将依据市场判断和政策分析，同时根据类别行业的周期性特点，采取适当的时机选择策略，以优化组合表现。

（2）债券投资策略

本基金采取“自上而下”为主，“自下而上”为辅的投资策略，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、市场

资产配置、券种选择 3 个层面进行主动性投资管理。积极运用“久期管理”，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

本基金业绩比较基准： $70\% \times \text{中信标普 300 指数} + 30\% \times \text{中信标普全债指数}$

10、风险收益特征

本基金为混合型基金，风险介于股票型和债券型基金之间，属于证券投资基金中的中低风险品种，适于能承担一定风险、追求较高收益和长期资本增值的投资人投资。

（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：中国证券报

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：中国证券登记结算有限责任公司

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 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	2006年6月30日
1、基金本期净收益	37,232,159.75
2、加权平均基金份额本期净收益	0.4839
3、期末可供分配基金净收益	24,294,543.52
4、期末可供分配基金份额收益	0.2862
5、期末基金资产净值	123,277,882.95
6、期末基金份额净值	1.4521
7、基金加权平均净值收益率	39.83%
8、本期基金份额净值增长率	67.81%
9、基金份额累计净值增长率	71.08%

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《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同》，本基金业绩比较基准是：70%×中信标普 300 指数+30%×中信标普全债指数

基准指数的构建考虑了三个原则：

1、公允性。选择市场认同度比较高的中信标普 300 指数、中信全债指数作为计算的基础指数；

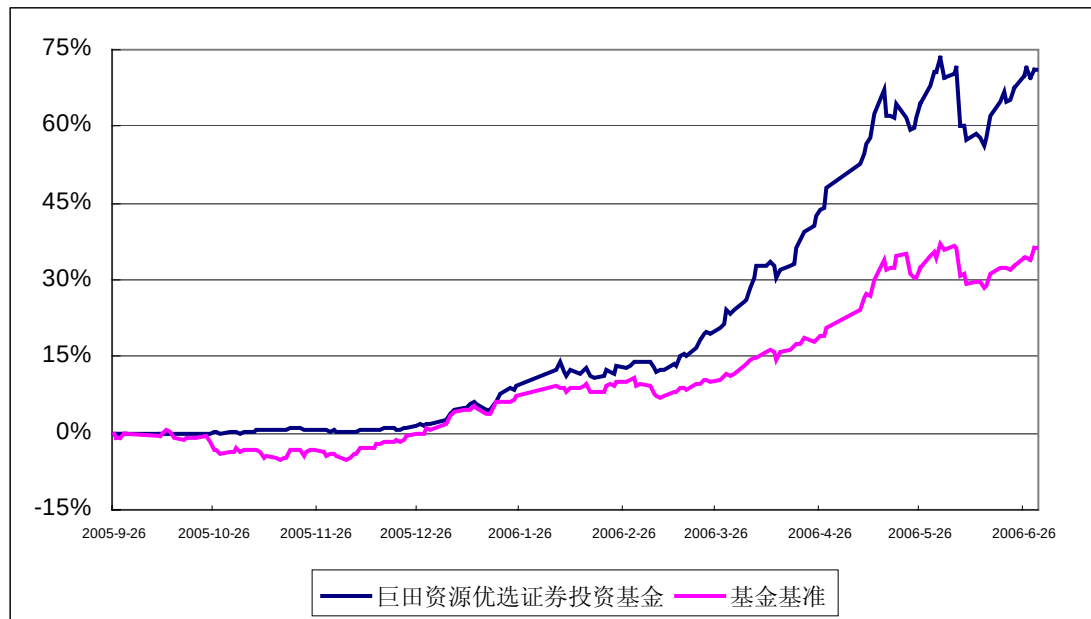
2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，虽然股票最高投资比例可达到 95%，但这一投资比例所对应的是阶段性、非常态的资产配置比例。在一般市场状况下，为控制基金风险，本基金股票投资比例会控制在 70%左右，债券投资比例控制在 30%以内。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性；

3、再平衡。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基金合同要求，基准指数每日按照 70%、30%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、巨田资源优选混合型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	0.30%	1.92%	1.49%	1.23%	-1.19%	0.69%
过去三个月	38.01%	1.61%	22.21%	1.20%	15.80%	0.41%
过去六个月	67.81%	1.32%	35.62%	0.98%	32.19%	0.34%
自基金合同生效 起至今	71.08%	1.07%	36.33%	0.87%	34.75%	0.20%

B、巨田资源优选混合型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：根据巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同规定，本基金投资于资源类上市公司股票的比例不低于基金股票资产的 80%；股票投资比例的变动范围为基金资产净值的 30%-95%；债券投资比例的变动范围为基金资产净值的 0%-65%；现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。法律法规和监管部门对上述比例另有规定时从其规定。2006 年 6 月 30 日，本基金股票投资占基金净值的 82.08%，其中资源类股票的比例为股票资产的 84.25 %；债券投资占基金净值的 0 %；现金资产占基金净值的 17.70%。本基金合同生效日为 2005 年 9 月 27 日，至报告披露时点（2006 年 6 月 30 日），本基金合同生效不满一年。

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两只开放式基金，即本基金和巨田基础行业证券投资基金。本基金是基金管理人管理的第二只基金。

2、基金经理简介

冀洪涛先生，经济学硕士，证券从业 8 年，历任华夏证券大连业务部研究发展部投资顾问、债券投资经理；大连证券研究发展总部副经理、兼沈阳业务部副总经理；巨田证券资产管理部、投资管理部投资经理；2004 年加入巨田基金管理有限公司，曾任巨田基础行业基金基金经理助理，现任投资管理部副总监、投资决策委员会委员。

（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。

（三）基金经理工作报告及展望

1、投资运作回顾

本基金至 2006 年上半年末，净值为 1.4521 元，累计净值为 1.6371，报告期净值增长率为 67.81%，而同期上证综指涨幅为 44.02%，基金业绩比较基准涨幅为 35.62%，远超过了上证综指和基金业绩比较基准，在同类型开放式基金中保持前列。本报告期间，本基金累计分红 4 次，每 10 份基金累计分红 1.85 元，基金持有人取得了一定的绝对投资回报。

2006 年上半年，本基金投资运作主要有以下特点：

A、由于对市场的整体判断有了较大改变，顺势而为是较为理性的操作，本基金整体仓位大幅增加，由 2005 年末的 26% 增加到 80% 左右。但由于部分个股短期内涨幅巨大，本基金进行了较大的结构性调整，对超出估值想像的个股进行了适当减持。

B、考虑到大宗商品价格的波动特性，对于矿产资源类的个股进行积极的波段操作，如黄金、钨、锌等，一季度以增仓为主，但进入 6 月以后，本基金减少了有色行业总体配置，增加了食品饮料行业和交通运输行业配置。主动性的调仓不仅锁定了部分收益，而且也使净值上升有了新的动力。

C、本报告期的整体加权仓位并不高，但净值仍保持了持续上升，主要原因是提高了投资运作的主动性，在二季度末适度降低仓位，进可攻退可守，预防可能随时发生的市场调整。虽然上升趋势中可能净值增长相对慢一些，但承担的风

险也较小，有利于基金净值的稳定。不冲动，保持冷静，敢于适度集中持有把握较大的投资目标，是下半年仍要坚持的策略。

D、上半年在操作上也有不足之处，尤其是二季度，对地产行业调控政策的影响没有足够敏感，导致在地产板块的投资中没能实现已有的获利，在一定程度上影响了基金收益。在今后的投资运作中，本基金将吸取教训，提高对政策的敏感性，规避风险。

2、火热市场中的冷思考及未来的策略选择

经过这段期间的投资运作，我们深深感受到了市场的强大，当所谓关键阻力一个个被多头成功占领时，也领略到了趋势投资的重要性。但随之而来的是困惑，究竟该如何在新的平台和起点上思考未来呢？这里有一个问题需要我们思索，市场上股票价格上涨的源动力是来自于企业盈力的增长还是来自于资金的推动？相关研究表明，股改因素和估值水平的提高成为本轮行情最主要的推动力，市场的整体估值水平确实提高了许多，当然很多人认为这是来自于对未来业绩增长的充分信心。但有些现象我们不得不关注，已经有研究员用 2008 年的业绩预测来解释今天的高 PE 个股了，市场中“讲故事”的人确实越来越多了，我们应该保持适度的谨慎和冷静。

客观讲，国内证券市场应该已基本完成价值回归的过程，目前的估值基本合理，在 QFII 的不断进入、H 股的回国发行、资本市场的资金和人才国际化等因素影响下，市场中明显低估的群体和个体越来越少了，虽然仍然有很大的结构性机会，但适当降低下半年的盈利预期是一个较为客观和理性的选择。6 月上旬的市场剧烈波动已经给了我们很多的警示，上涨过程中更要有风险意识。我们认为，中国证券市场现在确实是一个繁荣的开始，但却开始堆积结构性的泡沫，在部分所谓概念或主题投资上，真的搞不清是利用了泡沫还是被泡沫所利用，相信总会有撑不住的一天。

当我们看到在上涨行情中，投资者放弃持有大量股票的老基金不买，却挤破头的疯抢新发基金，逼得基金管理人不得不采用“复制”、“分拆”这种方式时；当所谓“股评人士”指挥着众多中小客户在几个涨停后还要追一个搞不清做什么能赚多少钱的上市公司股票时，我们不禁感慨市场中确实有许多不理性的成分，也许出现“百元股”和“仙股”真的是市场成熟的重要标志之一，在前行的过程

中，我们仍然有许多崎岖的路要走。

就具体的市场现象而言，中行的发行和上市引起我们许多思考，由于市场权重的改变，使得我们长期投资所依赖的参考标的有所改变，随着越来越多的大市值个股加盟 A 股，在全新的市场格局下如何进行投资运作是比较重要的问题。淡化指数，减少依赖，改变思考习惯，注重对行业及个股的研究和估值是未来一个理性的选择。

未来的投资策略

A、由于上半年的累积涨幅较大，获利盘也较为丰厚，市场有一定的调整压力，而下半年 IPO 及再融资加速进行，给投资者提供了更多的选择，所以市场的波动性会有所加大。操作上依然坚持锁定收益、控制风险的原则，适当降低盈利预期。

B、在股票选择上，重点关注以下几个方面：

第一、资源价值重估。我们已进入资源稀缺的时代，资源价值重估是一个长久的投资主题，无论是矿产资源股还是土地资源等，资源价值成为上市公司的估值底线，寻找波动中股价低于资源价值的个股，仍是未来成功率较高的选择。如黄金、旅游、地产、中药仍是有机会的。

第二、高成长的公司。业绩增长是股价上升最重要的支撑，在所谓后股权分置时代，有一些因素可能使企业出现超常规的发展，如股改使全体股东利益一致、已完成股权激励、股改后大股东优质资产注入等，重点关注这些因素有利于我们发现新的高成长公司。当然，行业发展状况及公司经营管理水平仍是我们考虑的最主要的因素。

第三、并购重组价值。虽然这种机会不好把握，寻找确定的投资目标并不容易，但不能否认这将是未来重要的投资方向之一。近期围绕水泥、钢铁的并购只是大戏的开始，未来仍有很大的投资参与空间，要积极关注。

总而言之，未来投资要保持冷静、谨慎，但仍有较多的机会，非常值得期待。虽然偶尔会有台风、雷暴烦扰，但火热的夏天已经扑面而来。

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、《巨田资源优选混合型

证券投资基金基金合同》，和《巨田资源优选混合型证券投资基金托管协议》，托管巨田资源优选混合型证券投资基金（以下简称巨田资源基金）。

2006 年上半年，中国光大银行在巨田资源基金托管过程中，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。

2006 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“巨田资源优选混合型证券投资基金 2006 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、巨田资源优选混合型证券投资基金资产负债表

单位：人民币元

资产：	附注	2006 年 6 月 30 日	2005 年 12 月 31 日
银行存款	5(5)	21,137,087.39	41,878,193.22
清算备付金		680,590.44	438,048.68
交易保证金		1,185,714.00	935,714.00
应收证券清算款		613,247.18	—

应收股利		31,860.00	—
应收利息	6(1)	2,617.49	1,215,182.22
应收申购款		985.22	—
股票投资市值		101,181,830.96	36,832,965.37
其中:股票投资成本		88,982,264.96	35,701,014.61
债券投资市值		—	56,795,860.00
其中:债券投资成本		—	56,809,277.12
权证投资市值		—	—
其中:权证投资成本		—	—
资产总计		124,833,932.68	138,095,963.49
负债:			
应付证券清算款		—	2,053,736.69
应付赎回款		449,453.15	159,203.03
应付赎回费		1,616.02	446.83
应付管理人报酬		148,042.81	125,128.85
应付托管费		24,673.80	20,854.83
应付佣金	6(3)	328,309.89	57,145.61
其他应付款	6(4)	500,350.00	250,000.00
预提费用	6(5)	103,604.06	250,000.00
负债合计		1,556,049.73	2,916,515.84
持有人权益:			
实收基金	6(6)	84,896,899.68	132,593,117.38
未实现利得(亏损)	6(7)	14,086,439.75	1,532,831.80
未分配收益		24,294,543.52	1,053,498.47
持有人权益合计		123,277,882.95	135,179,447.65
负债及持有人权益总计		124,833,932.68	138,095,963.49
基金份额净值		1.4521	1.0195

所附注释系会计报表的组成部分

2、巨田资源优选混合型证券投资基金经营业绩表

单位: 人民币元

项目	附注	2006.01.01-06.30
一、收入		
股票差价收入	6(8)	35,545,052.39
债券差价收入	6(9)	384,226.80
权证差价收入	6(10)	630,647.51
债券利息收入		136,235.62
存款利息收入		67,492.32
股利收入		1,146,218.25

买入返售证券收入		36,033.00
其他收入	6(11)	212,735.35
收入合计		38,158,641.24
二、费用		
基金管理人报酬	5(2)	695,632.62
基金托管费	5(2)	115,938.76
卖出回购证券支出		-
其他费用	6(12)	114,910.11
其中：信息披露费		49,588.57
审计费用		49,588.57
费用合计		926,481.49
三、基金净收益		37,232,159.75
加：未实现利得(亏损)		11,081,032.36
四、基金经营业绩		48,313,192.11

所附注释系会计报表的组成部分

3、巨田资源优选混合型证券投资基金净值变动表

单位：人民币元

	附注	2006.01.01-06.30
一、期初基金净值		135,179,447.65
二、本期经营活动：		
基金净收益		37,232,159.75
未实现利得(亏损)		11,081,032.36
经营活动产生的基金净值变动数		48,313,192.11
三、本期基金份额交易：		
基金申购款		65,882,066.89
基金赎回款		(113,860,417.36)
基金份额交易产生的基金净值变动数		(47,978,350.47)
四、本期向持有人分配收益		(12,236,406.34)
五、期末基金净值		123,277,882.95

所附注释系会计报表的组成部分

4、巨田资源优选混合型证券投资基金收益分配表

单位：人民币元

	附注	2006.01.01-06.30
本期基金净收益(亏损)		37,232,159.75
加：期初基金净收益		1,053,498.47

本期损益平准金		(1,754,708.36)
可供分配基金净收益		36,530,949.86
减：本期已分配基金净收益		12,236,406.34
期末基金净收益		24,294,543.52

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. 基金的基本情况

经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2005年5月9日证监基金字[2005]79号文《关于同意巨田资源优选混合型证券投资基金募集的批复》批准,巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)由巨田基金管理有限公司募集,募集期间为2005年8月8日至2005年9月20日。募集工作结束后,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(05)第SZ001号验证,本次募集的净认购金额为309,455,317.98元人民币,折合基金份额309,455,317.98份;认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计113,681.68元人民币,折合基金份额为113,681.68份。本基金首次募集规模为309,568,999.66份基金份额。经向中国证监会办理备案手续,本基金于2005年9月27日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。本基金为上市契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的管理人为巨田基金管理有限公司,托管人为中国光大银行。

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》及《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同》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。

(3) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(4) 记账基础和计价原则

本基金采用权责发生制为记账基础，资产在取得时以历史成本入账，股票投资、配股权证、权证和债券投资按本附注所述的估值原则进行后续计量。

(5) 基金资产的估值原则

A. 上市流通的有价证券以估值日证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日收盘价计算；

B. 未上市的属于配股、增发的股票以估值日证券交易所提供的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日收盘价计算；

C. 未上市的属于首次公开发行的股票、债券以其成本价计算；

D. 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价低于配股价，则估值增值额为零；

E. 银行间市场交易和未上市流通的债券以不含息价格计算，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个人所得税后在债券持有期间内计提利息，估值利息单列不计入成本；

F. 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日证券交易所挂牌的收盘价减去债券收盘价中所含的应收债券利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价减去债券收盘价中包含的应收债券利息得到的净价估值；

G. 未上市的权证(主要指发行日至上市日之间)及停牌的权证，综合考虑标的股票价格、行权价格、剩余天数、市场无风险利率、标的股票价格波动以及市场情况等因素，按照最能反映权证公允价值的价格估值；已上市的权证以其估值日该权证在证券交易所的收盘价计算；该日无交易的，以最近一个交易日的收盘价计算；

H. 如遇特殊情况而无法或不宜以上述方法确定资产价值时，或确凿证据表明按上述原则不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。若基金管理人坚持采用前款规定对基金资产估值，仍应被认为采用了适当的估值方法；

I. 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

(6) 证券投资的成本计价方法

A. 股票投资成本

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(包括成本总额和相关费用)入账。

卖出股票于成交日确认股票差价收入。卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

因股权分置改革而获得的由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复牌日冲减该股票的成本。因股权分置改革而获得的由非流通股股东支付的股票对价,记录获得的股票数量。

B. 债券投资成本

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,应支付的全部价款中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。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入。卖出债券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

买入银行间市场交易债券于实际支付价款日按实际支付的全部价款入账。如果实际支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日的利息,应作为应收利息单独核算,不构成债券成本。

卖出银行间市场交易的债券应于实际收到全部价款时确认债券差价收入。卖出债券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

买入央行票据和零息债券视同到期一次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。

C. 权证投资成本

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(包括成本总额和相关费用)入账。

因股权分置改革而获得的权证,在确认日,按持有的股票数量及获赠比例计算并记录获得的权证数量,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。卖出权证的成本按移动加权平均法计算结转。

(7) 待摊费用

待摊费用反映已经支付的、影响基金份额净值小数点后第五位,应于各受益

期分摊的费用。

(8) 预提费用

预提费用反映尚未支付的、影响基金份额净值小数点后第五位，应计入本期的费用。

(9) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额的面值为 1.00 元。由于申购、赎回、转换及红利再投资引起的实收基金的变动分别于相关活动的确认日认列。

(10) 未实现利得

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

未实现利得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占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(11) 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收益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收益。

(12) 基金的申购与赎回

在收到基金投资人申购或赎回申请之日后，于下一个工作日对该交易的有效性进行确认。对于已确认的申请，按照申请日实收基金、未实现利得、未分配收益和损益平准金的余额占基金净值的比例，将确认有效的申购或赎回款分割为三部分，分别确认为实收基金、未实现利得、损益平准金。

(13) 收入确认和计量

股票差价收入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入账。

证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认。债券差价收入按卖出债券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。

银行间市场交易的债券差价收入应于实际收到全部价款时确认。债券差价

收入按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除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应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的余额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出的资金及约定利率在返售期限内采用直线法逐日计提。

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成本和相关费用的差额入账。

其他收入于实际收到时确认为收入。

(14) 费用确认和计量

根据《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金管理费按基金前一日的资产净值乘以相应的管理费日费率来计算，具体计算方法如下：

每日应付的基金管理费=前一日基金的资产净值 $\times$ 1.50% $\div$ 当年天数

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

根据《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的托管费按基金前一日资产净值乘以相应的托管费日费率来计算。计算方法如下：

每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值 $\times$ 0.25% $\div$ 当年天数

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

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。

(15) 基金的收益分配政策

A. 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，最多6次，基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的60%，但若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

B. 场外投资人可以选择现金分红或红利再投资（即基金份额持有人将所获分配的现金收益按照本基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额）；场内

投资人只能选择现金分红；本基金分红的默认方式为现金分红；

C. 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；

D. 每一基金份额享有同等分配权；

法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

附注 3. 税项

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税字[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税字[2005]107 号文《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作规定，主要税项如下：

(1) 营业税

以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

基金买卖股票、债券的差价收入，免缴营业税。

(2) 所得税

基金买卖股票、债券的差价收入，免缴企业所得税。

对基金取得的股票股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。自 2005 年 6 月 13 日起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，依照现行税法规定代扣代缴个人所得税。

股权分置改革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，暂免缴纳流通股股东应缴纳的企业所得税和个人所得税。

(3) 印花税

基金买卖股票按 0.1% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

自 2005 年 6 月 13 日起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，暂免缴纳证券交易印花税。

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
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

巨田基金管理有限公司租用巨田证券交易席位进行投资交易，按如下标准向巨田证券支付相应交易佣金：

买卖股票类证券交易，分别按深圳证券交易所买卖成交金额的 0.8125%、上海证券交易所买卖成交金额的 0.85% 支付交易佣金。该等佣金比例系按照证券交易佣金支付标准、经手费、证管费等现行的有关规定确定，如管理部门对此重新规定，则进行相应变动。

债券现货及债券回购不计交易佣金。

上述协议中约定支付的相应交易佣金实际系由本基金向巨田证券直接支付。本基金获得了巨田证券提供的证券研究综合服务。

本期间基金通过关联方席位的股票成交量（无债券和回购交易量）、佣金及比例列示如下：

2006. 01. 01—06. 30						
关联方名称	本期成交金额		占成交总金额比例	本期应支付的交易佣金		占本期佣金总金额比例
巨田证券	RMB	123, 897, 660. 79	19. 21%	RMB	96, 951. 07	18. 63%

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并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

（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	2006. 01. 01—06. 30	
基金管理人报酬	RMB	695, 632. 62
基金托管费	RMB	115, 938. 76

(3) 本基金关联方期末持有本基金份额情况

本基金管理人于本基金募集期间认购本基金 3000 万元。2006 年 6 月 30 日，本基金管理人持有本基金 30, 458, 172. 66 份额，占基金总份额的 35. 88%，该比例超过 10%是由基金份额持有人赎回所致。

其他关联方未持有本基金的份额。

(4) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本期末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：

	2006 年 6 月 30 日
期末银行存款余额	21, 137, 087. 39
其中：活期存款	21, 137, 087. 39
定期存款	—
存款利息收入	56, 459. 11

(6) 关联方往来款项余额

项目	关联方名称	2006 年 6 月 30 日	
		金额	占该账项总金额的比例
应付佣金	巨田证券	48, 346. 76	14. 73%
其他应付款	巨田证券	250, 000. 00	49. 97%

附注 6. 基金会计报表重要项目注释（截至 2006 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	2,064.08
2	应收清算备付金利息	275.67
3	应收权证保证金利息	277.74
合计		2,617.49

（2）投资估值增值

序号	项目	余额
1	股票投资估值增值	12,199,566.00
合计		12,199,566.00

（3）应付佣金

序号	证券公司	余额
1	巨田证券	48,346.76
2	远东证券	41,777.49
3	世纪证券	173,020.21
4	金元证券	5,758.80
5	湘财证券	59,406.63
合计		328,309.89

（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	湘财证券代付交易保证金	250,000.00
3	债券银行间交易费	125.00
4	其他	225.00
合计		500,350.00

（5）预提费用

序号	项目	余额
----	----	----

1	审计费	49,588.57
2	上证报信息披露费	49,588.57
3	债券帐户维护费	4,426.92
合计		103,604.06

(6) 实收基金

序号	项目	余额
1	实收基金期初数	132,593,117.38
2	本期申购增加数	56,868,987.65
3	本期赎回减少数	104,565,205.35
4	实收基金期末数	84,896,899.68

(7) 未实现利得

序号	项目	余额
1	投资估值增值	12,199,566.00
2	本期申购的未实现利得平准金	7,121,541.14
3	本期赎回的未实现利得平准金	(5,234,667.39)
合计		14,086,439.75

(8) 股票差价收入

序号	项目	金额
1	卖出股票成交总额	314,114,521.68
2	卖出股票投资成本	(278,306,012.89)
3	应付佣金	(263,456.40)
4	股票差价收入合计	35,545,052.39

(9) 债券差价收入

序号	项目	金额
1	卖出债券成交总额	58,541,155.98
2	卖出债券投资成本	(56,809,277.12)
3	应收利息总额	(1,347,652.06)
4	债券差价收入合计	384,226.80

(10) 权证差价收入

序号	项目	金额
1	卖出权证成交总额	630,647.51
2	卖出权证成本	-
3	应付佣金	-
4	权证差价收入合计	630,647.51

(11) 其他收入

序号	项目	金额
1	赎回费收入	82,735.35
2	其他	130,000.00
合计		212,735.35

(12) 其他费用

序号	项目	金额
1	审计费用	49,588.57
2	信息披露费用	49,588.57
3	回购交易费用	550.05
4	银行手续费	1,181.00
5	债券帐户维护费	13,876.92
6	债券交易费用	125.00
合计		114,910.11

(13) 现金对价

本报告期内，本基金因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价而减少股票投资成本计 177,366.97 元。明细如下：

股票代码	股票名称	金额
000024	G 招商局	653.12
600519	G 茅台	176,713.85
合计		177,366.97

附注 7. 期末流通转让受到限制的基金资产

(1) 本基金截至 2006 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
中国银行	60,000	184,800.00	184,800.00	按成本	网上申购中签新股未上市	2006年7月5日上市
中国银行	146,186	450,252.88	450,252.88	按成本	网下申购中签新股未上市	新股上市后 50%3个月、50%6个月
合计		635,052.88	635,052.88			

（2）本基金截至 2006 年 6 月 30 日止因股权分置改革而流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	本期末数量（股）	本期末估值总额	复牌日期	复牌开盘单价
600415	小商品城	2006-6-19	63.27	120,000	7,592,400.00	2006-7-4	57.05
600543	莫高股份	2006-6-16	6.22	50,000	311,000.00	2006-7-10	6.63
600811	东方集团	2006-6-26	7.10	250,000	1,775,000.00	2006-7-6	6.73
合计					9,678,400.00		

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	101,181,830.96	81.05%
债券	—	—
权证	—	—
银行存款及清算备付金合计	21,817,677.83	17.48%
其他资产	1,834,423.89	1.47%
基金资产总值	124,833,932.68	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	6,213,200.00	5.04%
C 制造业	25,690,796.92	20.84%
C0 食品、饮料	14,869,900.00	12.06%
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	-	-
C6 金属、非金属	1,167,260.44	0.95%
C7 机械、设备、仪表	4,143,000.00	3.36%
C8 医药、生物制品	5,510,636.48	4.47%
C99 其他制造业	-	-
D 电力、煤气及水的生产和供应业	7,402,580.00	6.00%
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储业	26,441,720.00	21.45%
G 信息技术业	-	-
H 批发和零售贸易	11,672,581.16	9.47%
I 金融、保险业	11,043,552.88	8.96%
J 房地产业	-	-
K 社会服务业	3,350,000.00	2.72%
L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	9,367,400.00	7.60%
合计	101,181,830.96	82.08%

(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	600084	G 新 天	2,599,684.00	11,672,581.16	9.47%
2	600036	G 招 行	1,350,000.00	10,408,500.00	8.44%
3	600887	G 伊 利	410,000.00	9,343,900.00	7.58%
4	600009	G 沪机场	560,000.00	8,069,600.00	6.55%
5	600415	小商品城	120,000.00	7,592,400.00	6.16%
6	000690	G 宝能源	718,000.00	7,402,580.00	6.00%
7	600787	G 中 储	1,220,000.00	6,941,800.00	5.63%
8	000099	G 海 直	1,208,000.00	6,390,320.00	5.18%
9	600572	G 康恩贝	621,968.00	5,510,636.48	4.47%
10	600717	G 天津港	600,000.00	5,040,000.00	4.09%
11	000410	G 沈 机	300,000.00	4,143,000.00	3.36%
12	600547	G 鲁黄金	140,000.00	4,043,200.00	3.28%
13	000869	G 张 裕	100,000.00	3,761,000.00	3.05%
14	000888	G 峨眉山	500,000.00	3,350,000.00	2.72%
15	000762	G 藏矿业	200,000.00	2,170,000.00	1.76%
16	600811	东方集团	250,000.00	1,775,000.00	1.44%
17	000858	G 五粮液	100,000.00	1,454,000.00	1.18%
18	600456	G 宝 钛	24,476.00	1,167,260.44	0.95%
19	601988	中国银行	206,186.00	635,052.88	0.52%
20	600543	莫高股份	50,000.00	311,000.00	0.25%

合计				101,181,830.96	82.08%
----	--	--	--	----------------	--------

(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	600028	中国石化	24,314,214.49	17.99%
2	000069	G 华侨城	18,854,980.43	13.95%
3	600009	G 沪机场	14,621,268.84	10.82%
4	600036	G 招 行	14,513,861.01	10.74%
5	600415	小商品城	14,135,670.78	10.46%
6	600205	山东铝业	12,771,083.37	9.45%
7	600331	G 宏 达	12,498,567.66	9.25%
8	600787	G 中 储	11,643,994.27	8.61%
9	600084	G 新 天	11,077,809.77	8.19%
10	600887	G 伊 利	10,160,263.53	7.52%
11	600547	G 鲁黄金	9,593,683.21	7.10%
12	000690	G 宝能源	8,323,280.72	6.16%
13	600519	G 茅 台	8,142,516.29	6.02%
14	000099	G 海 直	8,109,031.24	6.00%
15	600811	东方集团	7,536,591.62	5.58%
16	600872	G 中 炬	7,239,925.68	5.36%
17	000869	G 张 裕	6,559,248.21	4.85%
18	000402	G 金融街	5,852,294.69	4.33%
19	000758	G 中 色	5,725,808.79	4.24%
20	600572	G 康恩贝	5,621,755.61	4.16%
21	000410	G 沈 机	5,379,068.38	3.98%
22	600717	G 天津港	5,327,393.89	3.94%
23	600549	G 厦 钨	5,176,537.43	3.83%
24	600000	G 浦 发	5,136,646.47	3.80%
25	600436	G 片仔癀	5,119,786.66	3.79%
26	000762	G 藏矿业	4,547,102.83	3.36%
27	600489	G 中黄金	4,177,579.92	3.09%
28	600085	G 同仁堂	3,943,335.21	2.92%
29	000895	双汇发展	3,633,619.11	2.69%
30	600855	G 长 峰	3,546,322.51	2.62%
31	600054	G 黄 山	3,289,170.42	2.43%
32	600535	G 天士力	3,156,268.44	2.33%

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	600028	中国石化	25,068,843.66	18.54%
2	000069	G 华侨城	18,974,351.84	14.04%
3	600549	G 厦 钨	18,052,810.18	13.35%
4	600331	G 宏 达	15,834,142.74	11.71%
5	600205	山东铝业	13,187,119.07	9.76%
6	000869	G 张 裕	12,517,757.97	9.26%
7	600436	G 片仔癀	11,869,001.65	8.78%
8	600872	G 中 炬	9,287,448.02	6.87%
9	600519	G 茅 台	9,004,968.21	6.66%
10	000099	G 海 直	7,764,284.39	5.74%
11	600009	G 沪机场	7,316,367.96	5.41%
12	600415	小商品城	7,209,681.41	5.33%
13	600547	G 鲁黄金	7,118,746.17	5.27%
14	000758	G 中 色	6,781,318.88	5.02%
15	600787	G 中 储	6,416,126.54	4.75%
16	600811	东方集团	5,878,344.96	4.35%
17	000402	G 金融街	5,651,323.96	4.18%
18	600036	G 招 行	5,608,190.52	4.15%
19	000895	双汇发展	5,486,231.95	4.06%
20	000690	G 宝能源	5,242,000.19	3.88%
21	600000	G 浦 发	5,002,857.31	3.70%
22	000061	G 农产品	4,851,297.22	3.59%
23	600489	G 中黄金	4,841,104.63	3.58%
24	000900	G 现投股	4,752,086.40	3.52%
25	600054	G 黄 山	4,473,916.49	3.31%
26	600585	G 海 螺	4,286,004.50	3.17%
27	600323	G 南 海	4,083,103.16	3.02%
28	600085	G 同仁堂	3,982,412.60	2.95%
29	600535	G 天士力	3,660,222.20	2.71%
30	000657	中钨高新	3,587,162.10	2.65%
31	000762	G 藏矿业	3,406,424.71	2.52%
32	600855	G 长 峰	3,396,468.91	2.51%
33	600900	G 长 电	2,776,554.00	2.05%

3、报告期内买入股票的成本总额为 331,764,630.21 元，卖出股票的收入总额为 314,114,521.68 元。

（五）截至报告期末未有债券投资

（六）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	1,185,714.00
2	证券清算款	613,247.18
3	应收利息	2,617.49
4	应收申购款	985.22
5	应收股利	31,860.00
合计		1,834,423.89

4、报告期末无处于转股期的可转换债券

5、报告期内因股权分置改革被动持有的权证明细

序号	权证代码	权证名称	获得权证数量（份）	成本总额（元）
1	580990	茅台 TCP1	191,690	0

本报告期内无主动投资的权证。

七、基金份额持有人户数、持有人结构

截至 2006 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：602 户
- 2、平均每户持有基金份额：141,024.75 份
- 3、机构投资者持有的基金份额为 70,875,938.60 份，占总份额的 83.48%
- 4、个人投资者持有的基金份额为 14,020,961.08 份，占总份额的 16.52%

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：309,568,999.66 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: 132,593,117.38 份
- (2) 报告期期末基金份额总额: 84,896,899.68 份
- (3) 报告期内基金总申购份额: 56,868,987.65 份
- (4) 报告期内基金总赎回份额: 104,565,205.35 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

序号	分红公告日	权益登记日 及除权日	每 10 份基金份额 收益分配金额(元)	收益分配金额 (元)
1	2006.01.10	2006.01.13	0.15	1,057,254.44
2	2006.02.09	2006.02.14	0.20	1,376,454.45
3	2006.03.10	2006.03.15	0.50	3,178,302.04
4	2006.04.07	2006.04.12	1.00	6,624,395.41
累计收益 分配			1.85	12,236,406.34

(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(2006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	123,897,660.79	19.21%	96,951.07	18.63%
远东证券	1	107,169,365.98	16.62%	87,638.89	16.84%
世纪证券	1	256,444,353.35	39.77%	209,984.12	40.35%
金元证券	1	81,458,184.60	12.63%	66,405.44	12.76%
湘财证券	1	75,918,290.88	11.77%	59,406.63	11.42%
合计	6	644,887,855.60	100.00%	520,386.15	100.00%

2、债券及回购交易情况（2006 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	—	—	—	—
远东证券	1	—	—	24,000,000.00	27.27%
世纪证券	1	4,896,753.04	100.00%	25,000,000.00	28.41%
金元证券	1	—	—	39,000,000.00	44.32%
湘财证券	1	—	—	—	—
合计	6	4,896,753.04	100.00%	88,000,000.00	100.00%

3、席位的变更情况

本基金在报告期内新增 2 家证券公司的 2 个席位：金元证券（1 个上海席位）、湘财证券（1 个深圳席位）。

（九）报告期内发生的其他重要事项

1、中信建投将作为华夏证券证券业务的继承人，原华夏证券与本基金管理人签订的所有代销协议中应由华夏证券享有和承担的权利义务，均变更为由中信建投享有和承担，华夏证券不再享有和承担原代销协议规定的任何权利义务。该事项已于 2006 年 1 月 24 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上公告。

2、根据公司业务发展的需要，巨田基金管理有限公司北京分公司营业场所由北京市朝阳区东三环北路 15 号恒安大厦 13 层，变更为：北京市海淀区中关村南大街 1 号友谊宾馆雅园 64841 室。该事项已于 2006 年 2 月 9 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上公告。

3、在 2006 年 4 月的正常交易日期间，巨田基金管理有限公司对旗下基金推出申购费率优惠活动。该事项已于 2006 年 3 月 30 日在《中国证券报》、《上海证

券报》和《证券时报》上公告。

4、经公司董事会批准，本基金管理人拟于 2006 年 4 月 25 日申购巨田基础行业基金 1000 万元，申购费率为 0.48%。该事项已于 2006 年 4 月 21 日在《上海证券报》和《证券时报》上公告。

十、备查文件目录

- 1、《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《巨田资源优选混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《巨田资源优选混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《巨田资源优选混合型证券投资基金 2005 年第四季度报告》
- 5、《巨田资源优选混合型证券投资基金 2005 年度报告》
- 6、《巨田资源优选混合型证券投资基金 2006 年第一季度报告》
- 7、《巨田资源优选混合型证券投资基金 2006 年第二季度报告》
- 8、在中国证监会指定报纸上公开披露的其他各项公告

巨田基金管理有限公司
二〇〇六年八月二十四日