

# 巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)

## 2007 年年度报告

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：2008年3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 2008 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

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 .....                 | 3  |
| 二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况 ..... | 5  |
| 三、基金管理人报告 .....              | 8  |
| 四、基金托管人报告 .....              | 12 |
| 五、审计报告 .....                 | 13 |
| 六、基金财务会计报告 .....             | 14 |
| 七、投资组合报告 .....               | 36 |
| 八、基金份额持有人户数、持有人结构 .....      | 47 |
| 九、开放式基金份额变动 .....            | 48 |
| 十、重大事件揭示 .....               | 48 |
| 十一、备查文件目录 .....              | 53 |

## 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（LOF）
- 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：1,633,098,805.45 份
- 7、基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 8、上市日期：2007 年 7 月 5 日
- 9、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。

### 10、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。

### 11、业绩比较基准

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

### 12、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 楼
- 3、办公地址：深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 楼
- 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、电子信箱：xxpl@jtfund.com

## （三）基金托管人情况

- 1、基金托管人名称：中国光大银行股份有限公司
- 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：唐双宁
- 6、信息披露负责人：张建春
- 7、联系电话：010—68560675
- 8、传真：010—68560661
- 9、电子信箱：zhangjianchun@cebbank.com

(四) 信息披露报刊、网站及置备地点

基金选定的信息披露报纸：《中国证券报》

登载年度报告正文的基金管理人互联网网址：<http://www.jtfund.com>

基金年度报告置备地点：基金管理人和基金托管人处

(五) 会计师事务所

- 1、名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
- 2、办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

(六) 注册登记机构

- 1、名称：中国证券登记结算有限责任公司
- 2、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、基金净值表现及收益分配情况

(一) 主要财务指标 (单位：人民币元)

|                      |                  |                |                |
|----------------------|------------------|----------------|----------------|
| 加权平均净值利润率            | 41.86%           | 75.53%         | 1.44%          |
| 本期份额净值增长率            | 159.00%          | 115.15%        | 1.95%          |
| 份额累计净值增长率            | 468.09%          | 119.34%        | 1.95%          |
| 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | 256,405,678.97   | 62,386,036.78  | 1,214,642.70   |
| 加权平均份额本期利润           | 0.7948           | 0.9479         | 0.0144         |
| 期末可供分配利润             | 465,361,995.52   | 1,678,552.31   | 1,053,498.47   |
| 期末可供分配份额利润           | 0.2850           | 0.0165         | 0.0079         |
| 期末基金资产净值             | 3,502,017,485.95 | 122,942,735.10 | 135,179,447.65 |
| 期末基金份额净值             | 2.1444           | 1.2083         | 1.0195         |

注：以上所述基金财务指标的计算期间：2007 年度为 1 月 1 日至 12 月 31 日，2006 年度为 1 月 1 日至 12 月 31 日，2005 年度为 2005 年 9 月 27 日至 12 月 31 日，不包括基金份额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。

2007 年 7 月 1 日基金实施新会计准则后，增加“本期利润”指标，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，原“加权平均份额本期净收益”名称调整为“加权平均份额本期利润”，原“期末可供分配收益”名称调整为“期末可供分配利润”，原“期末可供分配份额收益”名称调整为“期末可供分配份额利润”。

## （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（LOF）》，本基金业绩比较基准是： $70\% \times \text{中信标普 300 指数} + 30\% \times \text{中信标普全债指数}$

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、中信标普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；

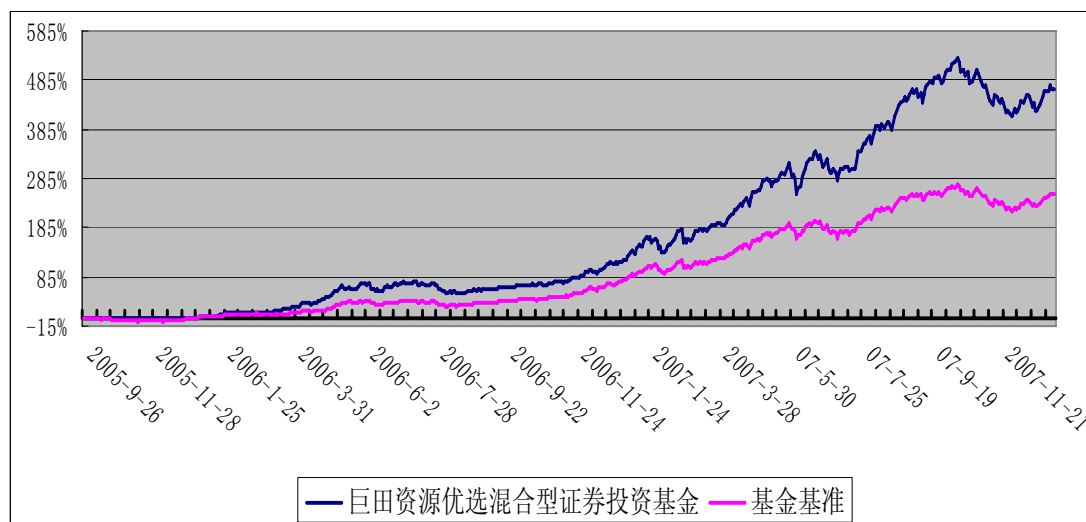
3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 70%、30% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### A、巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)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   | 净值增长率 | 业绩比较基准 | 业绩比较基准  | ①—③    | ②—④    |
|--------------------|---------|-------|--------|---------|--------|--------|
|                    | ①       | 标准差②  | 收益率③   | 收益率标准差④ |        |        |
| 过去一个月              | 9.62%   | 1.47% | 9.33%  | 1.11%   | 0.29%  | 0.36%  |
| 过去三个月              | -5.42%  | 1.73% | -2.14% | 1.37%   | -3.28% | 0.36%  |
| 过去六个月              | 43.60%  | 1.88% | 28.07% | 1.45%   | 15.53% | 0.43%  |
| 过去一年               | 159.00% | 2.21% | 98.12% | 1.61%   | 60.88% | 0.60%  |
| 基金合同生效至<br>2005 年底 | 1.95%   | 0.12% | 0.52%  | 0.61%   | 1.43%  | -0.49% |
| 2006 年全年           | 115.15% | 1.27% | 76.97% | 0.98%   | 38.18% | 0.29%  |

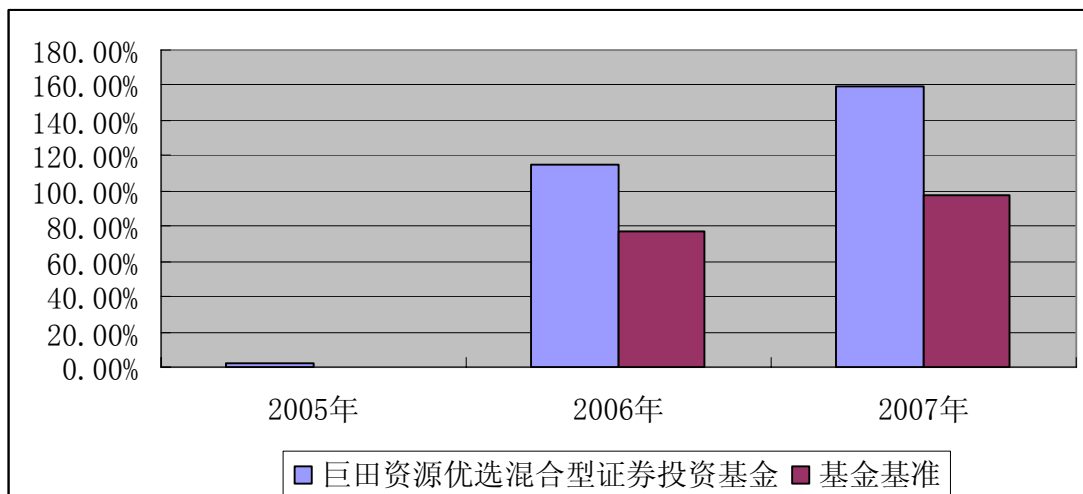
|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 2007 年全年   | 159.00% | 2.21% | 98.12%  | 1.61% | 60.88%  | 0.60% |
| 自基金合同生效起至今 | 468.09% | 1.70% | 252.44% | 1.28% | 215.65% | 0.42% |

**B、巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)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：根据本基金基金合同规定，本基金合同生效后 3 个月内，基金投资组合比例达到本基金合同的相关约定；本基金股票投资比例的变动范围为基金资产净值的 30%-95%，其中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%；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。截止 2007 年 12 月 31 日，本基金股票投资占基金净值的 84.41%，其中资源类股票的比例为股票资产的 91.54%；债券投资占基金净值的 2.78%；现金类资产占基金净值的 16.62%。

**C、巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图**



注：2005 年（基金合同生效当年）的净值增长率按本基金的实际存续期（2005 年 9 月 27 日至 2005 年 12 月 31 日）计算。

### （三）收益分配情况

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数（单位：元） | 备注 |
|--------|---------------------|----|
| 2005 年 | —                   |    |
| 2006 年 | 7.250               |    |
| 2007 年 | 5.100               |    |
| 合计     | 12.350              |    |

## 三、基金管理人报告

### （一）基金管理人及基金经理简介

#### 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。汉唐证券有限责任公司于 2005 年 6 月被行政关闭，现正式破产清算；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。

基金管理人旗下共管理三只开放式基金，即本基金、巨田基础行业证券投资

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 9 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，巨田货币市场基金基金经理，现任投资管理部副总监、投资决策委员会委员。

## （二）基金运作的遵规守信情况说明

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、《巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)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，本着恪守诚信，审慎勤勉，忠实尽责的原则认真履行了管理和运用基金财产的职责。报告期内基金管理人各项业务活动合规，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 2007 年年末基金净值为 2.1444 元，累计净值为 3.3794 元，报告期基金净值增长率为 159%，同期比较基准上涨 98.12%，而上证综合指数年度涨幅为 96.66%，基金涨幅远超过了比较基准和市场指数。

总体而言，本基金 2007 年整体表现尚可，但四季度表现较为一般，主要原因是持仓结构的调整不及时导致，三季度带来较大收益的有色金属板块及保险股四季度出现较大幅度的下跌，操作上虽然有所减仓，但力度不够。全年主要运作特汇报如下：

A、从阶段操作而言，一季度的投资主要以风格类中小市值个股为主，较为灵活地投资了海运、券商等类股票；第二季度的投资则以大盘股为主，包括金融、地产等板块；第三季度的投资以有色金属、煤炭、金融板块的股票为主，前三季度取得了不错的回报。四季度由于调整不够及时，没有将持仓转向化工、消费等方向，使得单季出现一定程度的亏损，应该说，由于四季度相比前三季度操作不够积极主动导致后期的被动，但四季度也进行了较大幅度的配置调整，为未来的收益打下了一定的基础。

B、在个股的操作上，继续发扬了长短结合的特色。虽然长期品种的招商银行、南山铝业、中信证券、平安保险等下半年有一定的负面影响，但中期品种中的山西三维、厦门国贸、中国国航等收获不少。

C、感谢持有人的信任，报告期基金管理规模迅速增长，从年初的 2 亿达到 30 亿以上。虽然四月份的规模快速扩张给投资带来一定压力，但操作上较为果断，实现了当期利益的最大化。后期在市场下跌过程中，操作上有一定的失误，较早的补仓行动使得基金收益率受到影响，而且对部分持仓品种的减持不够迅速、果断。进入 12 月份以后，基金也进行了一定程度的结构调整，但对于新进入的持有人来说，可能要付出更多的时间成本，管理人也相信，积极主动的结构调整是必要的也是必须的，具体的效果应该会逐渐体现出来。

总体来说本基金全年有一个先扬后抑的走势，由于后期对市场敏感性有些减弱，持仓调整不够及时，使得基金净值增长受到了一定程度的影响，年底的主动调整给基金净值未来重新上升带来了预期和空间。

## 2、未来的投资思考和投资方向的选择

2007 年给了我们很多值得深刻思索的内容，任何的高估值神话都不能脱离基本因素的支撑，否则在下跌过程中无法寻求支撑，当调整幅度较大时，许多投资目标又物有所值了。所以对目前市场背景下的投资有两点深刻感受：第一是现实总是不符合所谓的一致预期，当市场预期会再创新低时，却有力量止跌回稳，当市场预期最后一天应该以红盘报收，却跌了 40 多点，这也是市场的魅力所在；当各路专家预测 2008 年股指运行区间几乎一致时，看来收获一个不同的结果的可能性更大。第二点感受是投资机会是跌出来的，当市场普遍估值不低的情况下，结构性机会将是投资者需重点捕捉的主题，长期向好的宏观背景将成为股市的有力支撑，所以每一次大幅度的震荡应该是又给投资者提供了新一轮结构调整、持续盈利的机会，这样当我们面对 2008 年市场习惯性的震荡时，心里会平静一些。

对于未来的操作，我们仍然会坚持长、短期结合的投资策略，坚持以价值投资的投资理念进行投资运作。熟悉和接受市场可能发生的大幅波动，有效进行投资组合的动态调整，把握结构性的机会。

A、仍然坚持对资源股的中长期投资。虽然资源类个股出现了较大幅度的调整，但资源价值长期上升的趋势不会改变，2008 年仍然存在较大的资产重估机

会。

B、关注高成长的公司。一方面是企业内生的增长，如金融、交通运输、食品、化工等板；另一方面是企业外生性的增长，尤其积极关注资产注入类公司。资产注入和央企的整体上市将是 2008 年较大的投资主题。

总之，2007 年度是前期精彩、后期有些遗憾，但基金管理人确实是辛苦尽职的，希望广大基金持有人尤其是新加入的持有人给予支持和理解，毕竟这是长跑历程的一小段，并不能改变本基金的中长期投资业绩。真诚感谢长期持有人对巨田资源基金的支持和信任，这是一份沉甸甸的责任，也是基金管理人前行的动力。我们也会立足长远，不会为短期的排名争夺而改变中长期的投资理念，为您的财富增长继续努力。

#### （四）基金内部监察报告

报告期内基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将内部风险控制工作放在各项工作的首位。基金管理人的监察稽核工作涵盖了监督内控制度的执行情况、检查评价基金运作的合法性合规性、揭示内部管理及基金运作中的风险、及时提出改进意见、确保国家有关法律法规和基金管理人内控制度的有效执行等方面，通过资料审阅、现场检查、人员询问、重点项目专项检查等方法实施了对基金管理运作各方面的监察稽核。

为防范和化解经营风险，确保经营业务的稳健运行和安全完整，基金管理人主要采取了如下措施：

1、严格执行各项内控制度，及时修订完善各项内部管理制度。报告期内基金管理人根据最新法律法规的要求及时对部分内部管理制度和部门业务规章进行了修订，以保证各项业务活动的开展符合政策的最新要求，保证各项业务活动的合法合规和维护基金份额持有人的根本利益。

2、严格执行各项投资流程，保证基金投资运作的稳健规范。严格执行由授权、研究、决策、执行和评估等环节构成的投资管理系统，不断完善投资管理的内部控制制度，严格监控投资决策程序和投资过程以及投资交易品种和所持有交易品种的持仓比例，重点针对研究业务支持、投资授权遵守、关联交易业务控制等环节进行监督检查，确保投资运作的合法合规。

3、细化监察稽核工作流程，实现监察稽核工作的流程化、制度化。基金管理人不断明确监察稽核岗位的工作要点和步骤，不断完善、细化监察稽核工作流

程。

4、不断完善技术保障系统，保证各项业务运作正常有序进行。各项技术保障系统的运作是防范运作风险的重要前提之一。报告期内基金管理人的 TA 系统、基金会计核算系统、基金直销系统、投资交易系统、客户服务系统等均运作正常，并确保系统管理和业务操作权限分开的严格执行。

5、加强法律法规的学习和培训，树立坚定的遵法守法的工作信念，不断提高各项业务素质。基金管理人开展了灵活多样的法规教育与培训工作，通过树立每个员工的风险控制意识保证基金管理人各项工作的运转正常和健康发展，维护基金份额持有人的利益。

2008 年，基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以风险控制为核心，加强对基金内控工作的科学化建设，继续保障公司和基金的合法合规运作，保障基金份额持有人的合法权益，力争为基金份额持有人获取满意回报。

## 四、基金托管人报告

本基金托管人——中国光大银行，依据《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(LOF)基金合同》和《巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)托管协议》，托管巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)。

2007 年度，中国光大银行在巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)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》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，向基金管理人及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，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基金托管人所应尽的义务。

2007 年度，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》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——巨田基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、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。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作能够严格按照基金合同的规定进行。

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(LOF)2007 年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

中国光大银行 投资与托管业务部

2008 年 3 月 26 日

## 五、审计报告

普华永道中天审字(2008)第 20378 号

巨田资源优选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)（以下简称“巨田资源优选基金”）的财务报表，包括 2007 年 12 月 31 日的资产负债表、2007 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

### 一、 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是巨田资源优选基金的基金管理人巨田基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2)选择和运用恰当的会计政策；

(3)作出合理的会计估计。

### 二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求

我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则、《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了巨田资源优选基金 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所有限公司

注册会计师：薛 竞  
注册会计师：陈 宇

中国·上海市  
2008 年 3 月 24 日

六、 基金财务会计报告

（一）基金会计报表

巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)资产负债表

单位：人民币元

|  |  |        |        |
|--|--|--------|--------|
|  |  | 2007 年 | 2006 年 |
|--|--|--------|--------|

|                 | 附注 | 12 月 31 日               | 12 月 31 日             |
|-----------------|----|-------------------------|-----------------------|
| <b>资产</b>       |    |                         |                       |
| 银行存款            |    | 482,162,104.47          | 26,559,494.12         |
| 结算备付金           |    | 2,360,626.90            | 597,942.11            |
| 存出保证金           |    | 1,574,225.86            | 1,000,000.00          |
| 交易性金融资产         | 6  | 3,053,576,611.54        | 99,924,161.30         |
| 其中：股票投资         |    | 2,956,166,611.54        | 99,924,161.30         |
| 债券投资            |    | 97,410,000.00           | -                     |
| 资产支持证券投资        |    | -                       | -                     |
| 衍生金融资产          |    | -                       | -                     |
| 买入返售金融资产        |    | -                       | -                     |
| 应收证券清算款         |    | 4,870,577.02            | -                     |
| 应收利息            | 7  | 356,123.21              | 4,750.51              |
| 应收股利            |    | -                       | -                     |
| 应收申购款           |    | 5,110,070.05            | 902,173.55            |
| 其他资产            |    | -                       | -                     |
|                 |    |                         |                       |
| <b>资产总计</b>     |    | <b>3,550,010,339.05</b> | <b>128,988,521.59</b> |
|                 |    |                         |                       |
| <b>负债与持有人权益</b> |    |                         |                       |
| <b>负债：</b>      |    |                         |                       |
| 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           |    | 29,708,020.13           | 1,213,982.69          |
| 应付赎回款             |    | 10,234,309.82           | 3,634,980.13          |
| 应付管理人报酬           |    | 4,221,323.80            | 154,448.86            |
| 应付托管费             |    | 703,553.99              | 25,741.45             |
| 应付销售服务费           |    |                         |                       |
| 应付交易费用            | 8  | 1,897,744.26            | 342,332.01            |
| 应交税费              |    |                         |                       |
| 应付利息              |    | -                       |                       |
| 应付利润              |    |                         |                       |
| 其他负债              | 9  | 1,227,901.10            | 674,301.35            |
| <b>负债合计</b>       |    | <b>47,992,853.10</b>    | <b>6,045,786.49</b>   |
|                   |    |                         |                       |
| <b>所有者权益</b>      |    |                         |                       |
| 实收基金              | 10 | 1,633,098,805.45        | 101,749,373.62        |
| 未分配利润             |    | 1,868,918,680.50        | 21,193,361.48         |
| <b>所有者权益合计</b>    |    | <b>3,502,017,485.95</b> | <b>122,942,735.10</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |    | <b>3,550,010,339.05</b> | <b>128,988,521.59</b> |
| 基金份额总额(份)         | 10 | 1,633,098,805.45        | 101,749,373.62        |
| 基金份额净值            |    | 2.1444                  | 1.2083                |

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)利润表

单位：人民币元

|            | 附注 | 2007 年度      | 2006 年度    |
|------------|----|--------------|------------|
| <b>收入</b>  |    |              |            |
| 利息收入       |    | 2,278,448.84 | 325,119.95 |
| 其中：存款利息收入  |    | 1,480,489.41 | 151,418.41 |
| 债券利息收入     |    | 750,501.44   | 138,218.59 |
| 资产支持证券利息收入 |    | -            | -          |

|                 |    |                 |                |
|-----------------|----|-----------------|----------------|
| 买入返售金融资产收入      |    | 47,457.99       | 35,482.95      |
| 投资收益            |    | 301,312,639.90  | 66,514,094.63  |
| 其中：股票投资收益       | 11 | 291,735,370.85  | 62,744,152.40  |
| 债券投资收益          | 12 | 2,963,252.76    | 864,228.93     |
| 资产支持证券投资收益/(损失) |    | -               | -              |
| 衍生工具收益          | 13 | 418,753.16      | 1,428,882.05   |
| 股利收益            |    | 6,195,263.13    | 1,476,831.25   |
| 公允价值变动收益/(损失)   | 14 | 369,859,717.96  | 14,064,522.80  |
| 其他收入            | 15 | 2,890,619.19    | 149,550.59     |
| 收入合计            |    | 676,341,425.89  | 81,053,287.97  |
| 费用              |    |                 |                |
| 管理人报酬           |    | (21,932,063.31) | (1,514,075.55) |
| 托管费             |    | (3,655,343.80)  | (252,345.94)   |
| 销售服务费           |    | -               | -              |
| 交易费用            | 16 | (23,309,470.87) | (2,779,426.10) |
| 利息支出            |    | (901,698.31)    | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出   |    | (901,698.31)    | -              |
| 其他费用            | 17 | (277,452.67)    | (56,880.80)    |
| 费用合计            |    | (50,076,028.96) | (4,602,728.39) |
| 利润总额            |    | 626,265,396.93  | 76,450,559.58  |

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF)所有者权益（基金净值）变动表

单位：人民币元

|                         | 2007 年度            |                    |                    |
|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
|                         | 实收基金               | 未分配利润              | 所有者权益合计            |
| 年初所有者权益(基金净值)           | 101,749,373.62     | 21,193,361.48      | 122,942,735.10     |
| 本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润) | -                  | 626,265,396.93     | 626,265,396.93     |
| 本年基金份额交易产生的基金净值变动数      | 1,531,349,431.83   | 1,284,208,160.76   | 2,815,557,592.59   |
| 其中：基金申购款                | 2,934,839,621.45   | 2,300,503,884.14   | 5,235,343,505.59   |
| 基金赎回款                   | (1,403,490,189.62) | (1,016,295,723.38) | (2,419,785,913.00) |

|                          |                  |                  |                  |
|--------------------------|------------------|------------------|------------------|
| 本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数 | -                | (62,748,238.67)  | (62,748,238.67)  |
|                          |                  |                  |                  |
| 年末所有者权益(基金净值)            | 1,633,098,805.45 | 1,868,918,680.50 | 3,502,017,485.95 |
|                          |                  |                  |                  |
|                          | <b>2006 年度</b>   |                  |                  |
|                          | 实收基金             | 未分配利润            | 所有者权益合计          |
| 年初所有者权益(基金净值)            | 132,593,117.38   | 2,586,330.27     | 135,179,447.65   |
|                          |                  |                  |                  |
| 本年经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)  | -                | 76,450,559.58    | 76,450,559.58    |
|                          |                  |                  |                  |
| 本年基金份额交易产生的基金净值变动数       | (30,843,743.76)  | 753,748.65       | (30,089,995.11)  |
| 其中：基金申购款                 | 114,252,022.76   | 22,195,904.76    | 136,447,927.52   |
| 基金赎回款                    | (145,095,766.52) | (21,442,156.11)  | (166,537,922.63) |
|                          |                  |                  |                  |
| 本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数 | -                | (58,597,277.02)  | (58,597,277.02)  |
|                          |                  |                  |                  |
| 年末所有者权益(基金净值)            | 101,749,373.62   | 21,193,361.48    | 122,942,735.10   |

后附会计报表附注为本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）

### 1、基金基本情况

巨田资源优选混合型证券投资基金(LOF) (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[2005]第 79 号《关于同意巨田资源优选混合型证券投资基金募集的批复》核准,由巨田基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同(LOF)》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 309,455,317.98 元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(05)第 SZ001 号验资报告予以验证。经向中国

证监会备案,《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同(LOF)》于 2005 年 9 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 309,568,999.66 份基金份额,其中认购资金利息折合 113,681.68 份基金份额。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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2007]第 98 号文审核同意,本基金 7,579,696 份基金份额于 2007 年 7 月 5 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同(LOF)》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 30%-95%;债券投资占基金净值的 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%。其中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%。本基金的业绩比较基准为: 70%X 中信标普 300 指数+30%X 中信标普全债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人巨田基金管理有限公司于 2008 年 3 月 24 日批准报出。

## 2、财务报表的编制基础

本基金原以 2006 年 2 月 15 日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》(以下合称“原会计准则和制度”)、《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同(LOF)》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制财务报表。自 2007 年 7 月 1 日起,本基金开始执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。2007 年度财务报表为本基金首份按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同(LOF)》和中国证监会允许的如财务报表附注 4 所列示的基金行业实务操作的规定编制的年度财务报表。

在编制 2007 年度财务报表时,2006 年度以及 2007 年 1 月 1 日至 2007 年

6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，涉及的主要内容包括：将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，并将原计入所有者权益的公允价值变动计入当期损益。

本财务报表所有报表项目已按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》重新列报。按原会计准则和制度列报的 2006 年 1 月 1 日、2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》列报的所有者权益及净损益的金额调节过程列示于本财务报表附注 22。

### 3、遵循企业会计准则的声明

本基金 2007 年度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 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 4、重要会计政策和会计估计

#### (a) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### (b) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### (c) 金融资产和金融负债的分类及抵销

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

#### (d) 基金资产的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

##### (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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

由于送股、转增股、配股和公开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。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按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；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

### (iii) 权证投资

从获赠确认日、买入交易日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止，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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

(iv) 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，本基金的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。

### (e) 证券投资基金成本计价方法

(i) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

### （1）股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。2007 年 7 月 1 日之前，股票投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自 2007 年 7 月 1 日起，股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。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。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

### （2）债券投资

2007 年 7 月 1 日之前，买入证券交易所交易的债券于交易日确认为债券投资；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。债券投资成本按交易日应支付的全部价款并扣除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)后的金额确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额。

自 2007 年 7 月 1 日起，买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，上述公允价值不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)。

认购新发行的分离交易可转债于交易日按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按附注 4(e)(i)(3)所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。2007 年 7 月 1 日之前，卖出银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认债券投资收益/(损失)；自 2007 年 7 月 1 日起，卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

### （3）权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。2007 年 7 月 1 日之前，权证投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自 2007 年 7 月 1 日起，权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得

时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### (ii) 贷款和应收款项

2007 年 7 月 1 日之前,贷款和应收款项按实际支付或应收取的金额入账,并采用名义利率法确认相关的利息收入,其中买入返售金融资产以协议融出资金额作为入账金额;自 2007 年 7 月 1 日起,贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

#### (iii) 其他金融负债

2007 年 7 月 1 日之前,其他金融负债按实际收取或应支付的金额入账,并采用名义利率法确认负债相关的利息支出,其中卖出回购金融资产款以协议融入资金额作为入账金额;自 2007 年 7 月 1 日起,其他金融负债以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

#### (f) 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日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。

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，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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确认利息收入。自 2007 年 7 月 1 日起，若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日之前，买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按直线法逐日确认；自 2007 年 7 月 1 日起，买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

#### (g) 费用的确认和计量

本基金的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。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日之前，卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额在回购期内以直线法逐日确认；自 2007 年 7 月 1 日起，卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### (h) 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### (i) 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现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累计未实现利得/(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利润/(累计亏损)。

#### (j) 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，其中场外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，场内基金份额持有人只能选择现金分红。基金收益分配每年至少一次，最多六次，基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的 60%。基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益以及基金份额交易产生的未实现平准金等未实现部分。基金当期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所有者权益转出。

#### 5、主要税项

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》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》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，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%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 2007 年 5 月 30 日之前按照 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。

(e)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。

## 6、交易性金融资产

|           | 2007 年 12 月 31 日 |                  |                |
|-----------|------------------|------------------|----------------|
|           | 成本               | 公允价值             | 估值增值/(减值)      |
| 股票投资      | 2,571,071,837.14 | 2,956,166,611.54 | 385,094,774.40 |
| 债券投资      | 97,462,000.00    | 97,410,000.00    | (52,000.00)    |
| — 银行间同业市场 | 97,462,000.00    | 97,410,000.00    | (52,000.00)    |
|           | 2,668,533,837.14 | 3,053,576,611.54 | 385,042,774.40 |

|      | 2006 年 12 月 31 日 |               |               |
|------|------------------|---------------|---------------|
|      | 成本               | 公允价值          | 估值增值          |
| 股票投资 | 84,741,104.86    | 99,924,161.30 | 15,183,056.44 |

## 7、应收利息

|           | 2007 年 12 月 31 日 | 2006 年 12 月 31 日 |
|-----------|------------------|------------------|
| 应收债券利息    | 260,440.18       | —                |
| 应收银行存款利息  | 94,053.93        | 4,256.51         |
| 应收结算备付金利息 | 1,062.30         | 269.00           |
| 应收申购款利息   | 341.80           | —                |
| 应收存出保证金利息 | 225.00           | 225.00           |
|           | 356,123.21       | 4,750.51         |

## 8、应付交易费用

|               | 2007 年 12 月 31 日 | 2006 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|------------------|
| 应付交易所市场交易佣金   | 1,896,490.56     | 342,332.01       |
| 应付银行间同业市场交易费用 | 1,253.70         | —                |
|               | 1,897,744.26     | 342,332.01       |

## 9、其他负债

|           | 2007 年 12 月 31 日 | 2006 年 12 月 31 日 |
|-----------|------------------|------------------|
| 应付券商席位保证金 | 1,000,000.00     | 500,000.00       |
| 预提费用      | 189,500.00       | 164,500.00       |
| 应付赎回费     | 38,401.10        | 9,801.35         |
|           | 1,227,901.10     | 674,301.35       |

## 10、实收基金

|                  | 基金份额总额            | 实收基金              |
|------------------|-------------------|-------------------|
| 2006 年 12 月 31 日 | 101,749,373.62    | 101,749,373.62    |
| 本年申购             | 2,934,839,621.45  | 2,934,839,621.45  |
| 其中：红利再投资         | 35,199,642.53     | 35,199,642.53     |
| 本年赎回             | -1,403,490,189.62 | -1,403,490,189.62 |
| 2007 年 12 月 31 日 | 1,633,098,805.45  | 1,633,098,805.45  |

于 2007 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 153,541,000 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 1,479,557,805.45 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

### 11、股票投资收益

|            | 2007 年度            | 2006 年度          |
|------------|--------------------|------------------|
| 卖出股票成交金额   | 2,329,580,286.07   | 692,233,265.27   |
| 减：卖出股票成本总额 | (2,037,844,915.22) | (629,489,112.87) |
|            | 291,735,370.85     | 62,744,152.40    |

本基金于本年度内未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价（2006 年：216,966.97 元，已全额冲减股票投资成本）。

### 12、债券投资收益

|                 | 2007 年度         | 2006 年度         |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 卖出及到期兑付债券结算金额   | 78,599,195.00   | 61,906,062.58   |
| 减：应收利息总额        | (490,482.81)    | (1,349,635.03)  |
| 减：卖出及到期兑付债券成本总额 | (75,145,459.43) | (59,692,198.62) |
|                 | 2,963,252.76    | 864,228.93      |

### 13、衍生工具收益

|                 | 2007 年度        | 2006 年度      |
|-----------------|----------------|--------------|
| 卖出权证成交金额及权证行权收入 | 8,135,195.22   | 1,551,260.55 |
| 减：卖出权证及权证行权成本总额 | (7,716,442.06) | (122,378.50) |
|                 | 418,753.16     | 1,428,882.05 |

### 14、公允价值变动收益

|         | 2007 年度        | 2006 年度       |
|---------|----------------|---------------|
| 交易性金融资产 |                |               |
| — 股票投资  | 369,911,717.96 | 14,051,105.68 |
| — 债券投资  | (52,000.00)    | 13,417.12     |
|         | 369,859,717.96 | 14,064,522.80 |

### 15、其他收入

|             | 2007 年度      | 2006 年度    |
|-------------|--------------|------------|
| 赎回基金补偿收入(a) | 2,674,513.89 | 145,864.99 |
| 转换基金补偿收入(b) | 216,103.85   | 237.00     |
| 配债手续费返还     | -            | 3,448.60   |
| 其他          | 1.45         | -          |
|             | 2,890,619.19 | 149,550.59 |

(a) 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

(b) 本基金的转换费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

### 16、交易费用

|  | 2007 年度 | 2006 年度 |
|--|---------|---------|
|--|---------|---------|

|             |               |              |
|-------------|---------------|--------------|
| 交易所市场交易费用   | 23,308,145.87 | 2,779,301.10 |
| 银行间同业市场交易费用 | 1,325.00      | 125.00       |
|             | 23,309,470.87 | 2,779,426.10 |

**17、其他费用**

|           | 2007 年度    | 2006 年度     |
|-----------|------------|-------------|
| 信息披露费     | 100,000.00 | (30,000.00) |
| 审计费用      | 85,000.00  | 60,000.00   |
| 上市费用      | 60,000.00  | -           |
| 债券托管账户维护费 | 18,000.00  | 22,950.00   |
| 银行手续费     | 14,452.67  | 3,930.80    |
|           | 277,452.67 | 56,880.80   |

**18、收益分配**

本基金于 2007 年 3 月 30 日宣告分红，向截至 2007 年 3 月 29 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额 5.10 元派发现金红利。该分红的发放日为 2007 年 4 月 2 日，共发放红利 62,748,238.67 元，其中以现金形式发放 24,345,428.64 元，以红利再投资形式发放 38,402,810.03 元。

**19、重大关联方关系及关联交易****(a) 关联方**

| 关联方名称                  | 与本基金的关系      |
|------------------------|--------------|
| 巨田基金管理有限公司(“巨田基金”)     | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司(“中国光大银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 巨田证券有限责任公司(“巨田证券”)     | 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     |

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**(b) 通过关联方交易单元进行的证券交易及交易佣金**

|      | 2007 年度       |       |         |       |           |       |
|------|---------------|-------|---------|-------|-----------|-------|
|      | 买卖股票成交量       |       | 买卖债券成交量 |       | 交易佣金      |       |
|      | 成交量           | 占全年成交 | 成交量     | 占全年成交 | 佣金        | 占全年佣金 |
|      | 人民币元          | 量的比例  | 人民币元    | 量的比例  | 人民币元      | 总量的比例 |
| 巨田证券 | 60,017,473.56 | 0.89% | -       | -     | 46,963.80 | 0.86% |

|      | 2006 年度        |        |              |        |            |        |
|------|----------------|--------|--------------|--------|------------|--------|
|      | 买卖股票成交量        |        | 买卖债券成交量      |        | 交易佣金       |        |
|      | 成交量            | 占全年成交  | 成交量          | 占全年成交  | 佣金         | 占全年佣金  |
|      | 人民币元           | 量的比例   | 人民币元         | 量的比例   | 人民币元       | 总量的比例  |
| 巨田证券 | 269,901,667.75 | 19.81% | 1,041,904.15 | 12.61% | 213,569.39 | 19.43% |

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。

#### (c) 基金管理人报酬

支付管理人巨田基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本年度需支付管理人报酬 21,932,063.31 元 (2006 年：1,514,075.55 元)。

#### (d) 托管费

支付托管人中国光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付托管费 3,655,343.80 元 (2006 年：252,345.94 元)。

#### (e) 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，按银行同业利率计息。基金托管人于 2007 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 482,162,104.47 元 (2006 年：26,559,494.12 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 1,391,354.53 元 (2006 年：131,700.88 元)。

#### (f) 关联方持有的基金份额

|  | 2007 年 12 月 31 日 |    |       | 2006 年 12 月 31 日 |    |       |
|--|------------------|----|-------|------------------|----|-------|
|  | 基金份额             | 净值 | 占基金总份 | 基金份额             | 净值 | 占基金总份 |

|      |   |   |      |               |               |        |
|------|---|---|------|---------------|---------------|--------|
|      |   |   | 额的比例 |               |               | 额的比例   |
|      |   |   |      |               |               |        |
| 巨田基金 | - | - | -    | 30,458,172.66 | 36,802,610.03 | 29.93% |

基金管理人巨田基金在本年度由于分红再投资增加本基金 14,238,009.22 份基金份额，并且经代销机构赎回本基金 44,696,181.88 份基金份额(2006 年：申购 30,458,172.66 份)。

## 20、流通受限制不能自由转让的基金资产

基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至 2007 年 12 月 31 日止投资的因认购新发证券而于期末持有的流通受限证券情况如下：

| 股票代码   | 股票名称 | 成功认购日期   | 可流通日期    | 流通受限类型 | 认购价格  | 年末估值单价 | 数量        | 年末成本总额        | 年末估值总额        |
|--------|------|----------|----------|--------|-------|--------|-----------|---------------|---------------|
| 601857 | 中国石油 | 07/10/30 | 08/02/05 | 新股网下申购 | 16.70 | 30.96  | 832,422   | 13,901,447.40 | 25,771,785.12 |
| 601390 | 中国中铁 | 07/11/23 | 08/03/03 | 新股网下申购 | 4.80  | 11.49  | 2,013,937 | 9,666,897.60  | 23,140,136.13 |
| 601088 | 中国神华 | 07/09/27 | 08/01/09 | 新股网下申购 | 36.99 | 65.61  | 153,890   | 5,692,391.10  | 10,096,722.90 |
| 601866 | 中海集运 | 07/12/07 | 08/03/12 | 新股网下申购 | 6.62  | 12.15  | 633,465   | 4,193,538.30  | 7,696,599.75  |
| 002202 | 金风科技 | 07/12/18 | 08/03/26 | 新股网下申购 | 36.00 | 140.45 | 40,866    | 1,471,176.00  | 5,739,629.70  |
| 601601 | 中国太保 | 07/12/18 | 08/03/25 | 新股网下申购 | 30.00 | 49.45  | 89,424    | 2,682,720.00  | 4,422,016.80  |
| 002194 | 武汉凡谷 | 07/11/28 | 08/03/07 | 新股网下申购 | 21.10 | 51.91  | 33,001    | 696,321.10    | 1,713,081.91  |
| 601918 | 国投新集 | 07/12/07 | 08/03/19 | 新股网下申购 | 5.88  | 15.92  | 101,280   | 595,526.40    | 1,612,377.60  |
| 002183 | 怡亚通  | 07/11/02 | 08/02/13 | 新股网下申购 | 24.89 | 77.95  | 20,376    | 507,158.64    | 1,588,309.20  |
| 002176 | 江特电机 | 07/09/26 | 08/01/14 | 新股网下申购 | 11.80 | 35.08  | 41,666    | 491,658.80    | 1,461,643.28  |
| 002180 | 万力达  | 07/10/31 | 08/02/13 | 新股网下申购 | 13.88 | 34.39  | 31,372    | 435,443.36    | 1,078,883.08  |
| 002186 | 全聚德  | 07/11/07 | 08/02/20 | 新股网下申购 | 11.39 | 59.03  | 18,259    | 207,970.01    | 1,077,828.77  |
| 002182 | 云海金属 | 07/11/02 | 08/02/13 | 新股网下申购 | 10.79 | 27.93  | 32,956    | 355,595.24    | 920,461.08    |
| 002187 | 广百股份 | 07/11/12 | 08/02/22 | 新股网下申购 | 11.68 | 42.99  | 19,759    | 230,785.12    | 849,439.41    |
| 002179 | 中航光电 | 07/10/22 | 08/02/01 | 新股网下申购 | 16.19 | 45.85  | 17,146    | 277,593.74    | 786,144.10    |
| 600125 | 铁龙物流 | 07/12/27 | 08/01/07 | 公开增发   | 11.67 | 13.14  | 58,000    | 676,860.00    | 762,120.00    |
| 002185 | 华天科技 | 07/11/08 | 08/02/20 | 新股网下申购 | 10.55 | 21.44  | 33,697    | 355,503.35    | 722,463.68    |
| 002177 | 御银股份 | 07/10/24 | 08/02/01 | 新股网下申购 | 13.79 | 68.00  | 10,305    | 142,105.95    | 700,740.00    |
| 002184 | 海得控制 | 07/11/07 | 08/02/18 | 新股网下申购 | 12.90 | 23.01  | 16,852    | 217,390.80    | 387,764.52    |
| 002189 | 利达光电 | 07/11/19 | 08/03/03 | 新股网下申购 | 5.10  | 14.70  | 24,710    | 126,021.00    | 363,237.00    |

|        |      |          |          |        |       |       |        |                      |                      |
|--------|------|----------|----------|--------|-------|-------|--------|----------------------|----------------------|
| 002193 | 山东如意 | 07/11/28 | 08/03/07 | 新股网下申购 | 13.07 | 24.10 | 15,044 | 196,625.08           | 362,560.40           |
| 002181 | 粤传媒  | 07/11/07 | 08/02/18 | 新股网下申购 | 7.49  | 26.68 | 12,421 | 93,033.29            | 331,392.28           |
| 002201 | 九鼎新材 | 07/12/13 | 08/03/26 | 新股网下申购 | 10.19 | 31.87 | 10,176 | 103,693.44           | 324,309.12           |
| 002178 | 延华智能 | 07/10/24 | 08/02/01 | 新股网下申购 | 7.89  | 23.20 | 10,994 | 86,742.66            | 255,060.80           |
| 002199 | 东晶电子 | 07/12/12 | 08/03/21 | 新股网下申购 | 8.80  | 25.50 | 9,645  | 84,876.00            | 245,947.50           |
| 002196 | 方正电机 | 07/12/04 | 08/03/12 | 新股网下申购 | 7.48  | 24.38 | 9,880  | 73,902.40            | 240,874.40           |
| 002188 | 新嘉联  | 07/11/12 | 08/02/22 | 新股网下申购 | 10.07 | 21.46 | 11,180 | 112,582.60           | 239,922.80           |
| 002195 | 海隆软件 | 07/12/04 | 08/03/12 | 新股网下申购 | 10.49 | 32.86 | 6,796  | 71,290.04            | 223,316.56           |
| 002175 | 广陆数测 | 07/09/26 | 08/01/14 | 新股网下申购 | 11.09 | 35.20 | 6,000  | 66,540.00            | 211,200.00           |
| 合 计    |      |          |          |        |       |       |        | <b>43,813,389.42</b> | <b>93,325,967.89</b> |

截至 2007 年 12 月 31 日止, 本基金持有浙江中国小商品城集团股份有限公司(以下简称“小商品城”)停市股票 40,000 股, 账面成本为 2,855,143.80 元。按 2007 年 12 月 10 日收盘价每股 86.59 元计算, 估值为 3,463,600.00 元。小商品城因筹划定向增发事宜, 公司股票于 2007 年 12 月 11 日起连续停牌。小商品城于 2008 年 3 月 5 日复牌, 复牌后首日上市开盘价为 95.25 元。

## 21、风险管理

### (a) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 在董事会下设立合规审查委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理。监察稽核部对公司总经理负责, 并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了以合规审查委员会为核心的, 由合规审查委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

### (b) 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于

具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

#### (c) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，因此除在附注 20 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### (d) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

##### (i) 市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资占基金净值的 30%-95%，债券投资占基金净值的 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%。于 2007 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

|                | 2007 年 12 月 31 日 |            | 2006 年 12 月 31 日 |            |
|----------------|------------------|------------|------------------|------------|
|                | 公允价值             | 占基金资产净值的比例 | 公允价值             | 占基金资产净值的比例 |
| <b>交易性金融资产</b> |                  |            |                  |            |
| － 股票投资         | 2,956,166,611.54 | 84.41%     | 99,924,161.30    | 81.28%     |
| － 债券投资         | 97,410,000.00    | 2.78%      | －                | 0.00%      |
|                | 3,053,576,611.54 | 87.19%     | 99,924,161.30    | 81.28%     |

于 2007 年 12 月 31 日，若本基金业绩比较基准(见附注 1)上升 5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约 23,322 万元(2006 年：691 万元)；反之，若本基金业绩比较基准(见附注 1)下降 5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约 23,322 万元(2006 年：691 万元)。

## (ii) 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

| 2007 年 12 月 31 日 | 6 个月以内         | 6 个月至 1 年     | 1 至 5 年 | 不计息              | 合计               |
|------------------|----------------|---------------|---------|------------------|------------------|
| <b>资产</b>        |                |               |         |                  |                  |
| 银行存款             | 482,162,104.47 | －             | －       | －                | 482,162,104.47   |
| 结算备付金            | 2,360,626.90   | －             | －       | －                | 2,360,626.90     |
| 存出保证金            | －              | －             | －       | 1,574,225.86     | 1,574,225.86     |
| 交易性金融资产          | 39,668,000.00  | 57,742,000.00 | －       | 2,956,166,611.54 | 3,053,576,611.54 |
| 应收证券清算款          | －              | －             | －       | 4,870,577.02     | 4,870,577.02     |
| 应收利息             | －              | －             | －       | 356,123.21       | 356,123.21       |
| 应收申购款            | －              | －             | －       | 5,110,070.05     | 5,110,070.05     |
| 资产总计             | 524,190,731.37 | 57,742,000.00 | －       | 2,968,077,607.68 | 3,550,010,339.05 |
| <b>负债</b>        |                |               |         |                  |                  |
| 应付证券清算款          | －              | －             | －       | 29,708,020.13    | 29,708,020.13    |
| 应付赎回款            | －              | －             | －       | 10,234,309.82    | 10,234,309.82    |
| 应付管理人报酬          | －              | －             | －       | 4,221,323.80     | 4,221,323.80     |
| 应付托管费            | －              | －             | －       | 703,553.99       | 703,553.99       |
| 应付交易费用           | －              | －             | －       | 1,897,744.26     | 1,897,744.26     |
| 其他负债             | －              | －             | －       | 1,227,901.10     | 1,227,901.10     |

|         |                |               |   |                  |                  |
|---------|----------------|---------------|---|------------------|------------------|
| 负债总计    | -              | -             | - | 47,992,853.10    | 47,992,853.10    |
| 利率敏感度缺口 | 524,190,731.37 | 57,742,000.00 | - | 2,920,084,754.58 | 3,502,017,485.95 |

| 2006 年 12 月 31 日 | 6 个月以内        | 6 个月至 1 年 | 1 至 5 年 | 不计息            | 合计             |
|------------------|---------------|-----------|---------|----------------|----------------|
| <b>资产</b>        |               |           |         |                |                |
| 银行存款             | 26,559,494.12 | -         | -       | -              | 26,559,494.12  |
| 结算备付金            | 597,942.11    | -         | -       | -              | 597,942.11     |
| 存出保证金            | -             | -         | -       | 1,000,000.00   | 1,000,000.00   |
| 交易性金融资产          | -             | -         | -       | 99,924,161.30  | 99,924,161.30  |
| 应收利息             | -             | -         | -       | 4,750.51       | 4,750.51       |
| 应收申购款            | -             | -         | -       | 902,173.55     | 902,173.55     |
| 资产总计             | 27,157,436.23 | -         | -       | 101,831,085.36 | 128,988,521.59 |
| <b>负债</b>        |               |           |         |                |                |
| 应付证券清算款          | -             | -         | -       | 1,213,982.69   | 1,213,982.69   |
| 应付赎回款            | -             | -         | -       | 3,634,980.13   | 3,634,980.13   |
| 应付管理人报酬          | -             | -         | -       | 154,448.86     | 154,448.86     |
| 应付托管费            | -             | -         | -       | 25,741.45      | 25,741.45      |
| 应付交易费用           | -             | -         | -       | 342,332.01     | 342,332.01     |
| 其他负债             | -             | -         | -       | 674,301.35     | 674,301.35     |
| 负债总计             | -             | -         | -       | 6,045,786.49   | 6,045,786.49   |
| 利率敏感度缺口          | 27,157,436.23 | -         | -       | 95,785,298.87  | 122,942,735.10 |

于 2007 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产的比例低于 5%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2006 年：同）。

### (iii) 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 22、首次执行企业会计准则

如附注 2 所述，本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，所有报表项目已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的 2006 年 1 月 1 日、2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下：

|                              | 2006 年 1 月 1 日<br>所有者权益 | 2006 年度<br>净损益 | 2006 年 12 月 31 日<br>所有者权益 |
|------------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|
| 按原会计准则和制度列报的金额               | 135,179,447.65          | 62,386,036.78  | 122,942,735.10            |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注 2) | -                       | 14,064,522.80  | -                         |
| 按企业会计准则列报的金额                 | 135,179,447.65          | 76,450,559.58  | 122,942,735.10            |

|                              | 2007 年 1 月 1 日<br>所有者权益 | 2007 年 1 月 1 日<br>至 2007 年 6 月 30<br>日止期间净损益<br>(未经审计) | 2007 年 6 月 30 日<br>所有者权益<br>(未经审计) |
|------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------------|
| 按原会计准则和制度列报的金额               | 122,942,735.10          | 131,138,799.80                                         | 1,067,974,880.61                   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(附注 2) | -                       | 112,311,814.13                                         | -                                  |
| 按企业会计准则列报的金额                 | 122,942,735.10          | 243,450,613.93                                         | 1,067,974,880.61                   |

根据上述追溯调整,按原会计准则和制度直接记入所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的“公允价值变动收益/(损失)”科目中核算,相应的未实现损益平准金现按企业会计准则直接记入“未分配利润/(累计亏损)”科目。于会计期末,按原会计准则和制度列示于所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目中的全部余额,现按企业会计准则包含于“未分配利润/(累计亏损)”科目中。

## 七、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           | 2,956,166,611.54 | 83.27%    |
| 债券           | 97,410,000.00    | 2.74%     |
| 权证           | -                | -         |
| 银行存款及清算备付金合计 | 484,522,731.37   | 13.65%    |
| 其他资产         | 11,910,996.14    | 0.34%     |
| 基金资产总计       | 3,550,010,339.05 | 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)      | 市值占净值比例 |
|------------|----------------|---------|
| A 农、林、牧、渔业 | 3,990,000.00   | 0.11%   |
| B 采掘业      | 359,667,955.97 | 10.27%  |
| C 制造业      | 688,753,794.62 | 19.67%  |

|                  |                  |        |
|------------------|------------------|--------|
| C0 食品、饮料         | 15,710,214.46    | 0.45%  |
| C1 纺织、服装、皮毛      | 362,560.40       | 0.01%  |
| C2 木材、家具         | -                | -      |
| C3 造纸、印刷         | 50,470,931.79    | 1.44%  |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 69,656,483.85    | 1.99%  |
| C5 电子            | 2,357,715.08     | 0.07%  |
| C6 金属、非金属        | 344,986,837.10   | 9.85%  |
| C7 机械、设备、仪表      | 9,432,970.46     | 0.27%  |
| C8 医药、生物制品       | 195,776,081.48   | 5.59%  |
| C99 其他制造业        | -                | -      |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 225,162,112.00   | 6.43%  |
| E 建筑业            | 54,028,136.13    | 1.54%  |
| F 交通运输、仓储业       | 603,028,265.44   | 17.22% |
| G 信息技术业          | 102,742,800.63   | 2.93%  |
| H 批发和零售贸易        | 73,853,035.81    | 2.11%  |
| I 金融、保险业         | 729,019,457.04   | 20.82% |
| J 房地产业           | 45,402,000.00    | 1.30%  |
| K 社会服务业          | 66,724,061.62    | 1.91%  |
| L 传播与文化产业        | 331,392.28       | 0.01%  |
| M 综合类            | 3,463,600.00     | 0.10%  |
| 合计               | 2,956,166,611.54 | 84.41% |

## (三) 报告期末基金投资的所有股票明细

| 股票代码   | 股票名称 | 期末库存(股)   | 期末市值(元)        | 市值占净值比例 |
|--------|------|-----------|----------------|---------|
| 600030 | 中信证券 | 2,498,888 | 223,075,731.76 | 6.37%   |
| 600036 | 招商银行 | 4,838,888 | 191,765,131.44 | 5.48%   |
| 000690 | 宝新能源 | 7,699,888 | 184,797,312.00 | 5.28%   |
| 601318 | 中国平安 | 1,278,811 | 135,681,847.10 | 3.87%   |
| 601006 | 大秦铁路 | 5,080,838 | 130,171,069.56 | 3.72%   |
| 601111 | 中国国航 | 4,518,800 | 123,995,872.00 | 3.54%   |
| 600219 | 南山铝业 | 4,338,888 | 115,804,920.72 | 3.31%   |
| 601628 | 中国人寿 | 1,688,801 | 97,849,129.94  | 2.79%   |
| 600026 | 中海发展 | 2,522,938 | 93,399,164.76  | 2.67%   |
| 600028 | 中国石化 | 3,880,000 | 90,908,400.00  | 2.60%   |
| 601088 | 中国神华 | 1,333,029 | 87,460,032.69  | 2.50%   |
| 600436 | 片仔癀  | 2,299,088 | 87,089,453.44  | 2.49%   |
| 002128 | 露天煤业 | 1,738,856 | 86,090,760.56  | 2.46%   |

|        |       |           |               |       |
|--------|-------|-----------|---------------|-------|
| 600050 | 中国联通  | 6,880,008 | 83,110,496.64 | 2.37% |
| 000522 | 白云山 A | 5,510,088 | 80,337,083.04 | 2.29% |
| 000960 | 锡业股份  | 1,210,553 | 79,969,131.18 | 2.28% |
| 601328 | 交通银行  | 4,880,000 | 76,225,600.00 | 2.18% |
| 600019 | 宝钢股份  | 4,258,800 | 74,273,472.00 | 2.12% |
| 600717 | 天津港   | 2,298,479 | 62,978,324.60 | 1.80% |
| 601919 | 中国远洋  | 1,259,818 | 53,743,835.88 | 1.53% |
| 600153 | 建发股份  | 2,000,000 | 51,860,000.00 | 1.48% |
| 600966 | 博汇纸业  | 2,250,153 | 50,470,931.79 | 1.44% |
| 600489 | 中金黄金  | 420,000   | 47,943,000.00 | 1.37% |
| 600005 | 武钢股份  | 2,400,000 | 47,280,000.00 | 1.35% |
| 600009 | 上海机场  | 1,258,800 | 47,230,176.00 | 1.35% |
| 600787 | 中储股份  | 3,500,000 | 46,690,000.00 | 1.33% |
| 600900 | 长江电力  | 2,020,000 | 39,369,800.00 | 1.12% |
| 600017 | 日照港   | 2,288,301 | 36,361,102.89 | 1.04% |
| 000758 | 中色股份  | 800,000   | 30,888,000.00 | 0.88% |
| 000002 | 万科 A  | 900,000   | 25,956,000.00 | 0.74% |
| 601857 | 中国石油  | 832,422   | 25,771,785.12 | 0.74% |
| 000069 | 华侨城 A | 500,000   | 25,125,000.00 | 0.72% |
| 000623 | 吉林敖东  | 359,000   | 24,178,650.00 | 0.69% |
| 601390 | 中国中铁  | 2,013,937 | 23,140,136.13 | 0.66% |
| 000655 | 金岭矿业  | 600,000   | 21,318,000.00 | 0.61% |
| 600596 | 新安股份  | 300,000   | 20,139,000.00 | 0.58% |
| 000933 | 神火股份  | 380,000   | 19,881,600.00 | 0.57% |
| 000888 | 峨眉山 A | 1,197,551 | 19,579,958.85 | 0.56% |
| 600048 | 保利地产  | 300,000   | 19,446,000.00 | 0.56% |
| 600054 | 黄山旅游  | 603,600   | 19,097,904.00 | 0.55% |
| 600426 | 华鲁恒升  | 720,000   | 19,080,000.00 | 0.54% |
| 600697 | 欧亚集团  | 689,340   | 17,550,596.40 | 0.50% |
| 002153 | 石基信息  | 124,519   | 17,308,141.00 | 0.49% |
| 600309 | 烟台万华  | 398,357   | 15,157,483.85 | 0.43% |
| 600352 | 浙江龙盛  | 800,000   | 13,920,000.00 | 0.40% |
| 600600 | 青岛啤酒  | 355,239   | 13,904,054.46 | 0.40% |
| 601866 | 中海集运  | 633,465   | 7,696,599.75  | 0.22% |
| 002202 | 金风科技  | 40,866    | 5,739,629.70  | 0.16% |
| 601601 | 中国太保  | 89,424    | 4,422,016.80  | 0.13% |
| 600535 | 天士力   | 189,500   | 4,170,895.00  | 0.12% |
| 600189 | 吉林森工  | 200,000   | 3,990,000.00  | 0.11% |
| 600660 | 福耀玻璃  | 97,050    | 3,480,213.00  | 0.10% |
| 600415 | 小商品城  | 40,000    | 3,463,600.00  | 0.10% |
| 000061 | 农产品   | 100,000   | 2,888,000.00  | 0.08% |
| 000869 | 张裕 A  | 21,100    | 1,806,160.00  | 0.05% |

|        |      |         |                  |        |
|--------|------|---------|------------------|--------|
| 002194 | 武汉凡谷 | 33,001  | 1,713,081.91     | 0.05%  |
| 002088 | 鲁阳股份 | 36,200  | 1,616,330.00     | 0.05%  |
| 601918 | 国投新集 | 101,280 | 1,612,377.60     | 0.05%  |
| 002183 | 怡亚通  | 20,376  | 1,588,309.20     | 0.05%  |
| 002176 | 江特电机 | 41,666  | 1,461,643.28     | 0.04%  |
| 000707 | 双环科技 | 100,000 | 1,360,000.00     | 0.04%  |
| 002180 | 万力达  | 31,372  | 1,078,883.08     | 0.03%  |
| 002186 | 全聚德  | 18,259  | 1,077,828.77     | 0.03%  |
| 600396 | 金山股份 | 50,000  | 995,000.00       | 0.03%  |
| 002182 | 云海金属 | 32,956  | 920,461.08       | 0.03%  |
| 002187 | 广百股份 | 19,759  | 849,439.41       | 0.02%  |
| 002179 | 中航光电 | 17,146  | 786,144.10       | 0.02%  |
| 600125 | 铁龙物流 | 58,000  | 762,120.00       | 0.02%  |
| 002185 | 华天科技 | 33,697  | 722,463.68       | 0.02%  |
| 600327 | 大厦股份 | 50,000  | 705,000.00       | 0.02%  |
| 002177 | 御银股份 | 10,305  | 700,740.00       | 0.02%  |
| 002184 | 海得控制 | 16,852  | 387,764.52       | 0.01%  |
| 002189 | 利达光电 | 24,710  | 363,237.00       | 0.01%  |
| 002193 | 山东如意 | 15,044  | 362,560.40       | 0.01%  |
| 002181 | 粤传媒  | 12,421  | 331,392.28       | 0.01%  |
| 002201 | 九鼎新材 | 10,176  | 324,309.12       | 0.01%  |
| 002178 | 延华智能 | 10,994  | 255,060.80       | 0.01%  |
| 002199 | 东晶电子 | 9,645   | 245,947.50       | 0.01%  |
| 002196 | 方正电机 | 9,880   | 240,874.40       | 0.01%  |
| 002188 | 新嘉联  | 11,180  | 239,922.80       | 0.01%  |
| 002195 | 海隆软件 | 6,796   | 223,316.56       | 0.01%  |
| 002175 | 广陆数测 | 6,000   | 211,200.00       | 0.01%  |
| 合计     |      |         | 2,956,166,611.54 | 84.41% |

## (四) 报告期内股票投资组合的重大变动情况

## 1、累计买入金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

| 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额(元)    | 占期初净值比例 |
|--------|------|----------------|---------|
| 600030 | 中信证券 | 213,017,858.01 | 173.27% |
| 000690 | 宝新能源 | 206,532,530.37 | 167.99% |
| 600036 | 招商银行 | 191,918,630.95 | 156.10% |
| 600028 | 中国石化 | 161,713,711.90 | 131.54% |
| 600219 | 南山铝业 | 142,433,798.96 | 115.85% |
| 601318 | 中国平安 | 123,727,640.57 | 100.64% |
| 601088 | 中国神华 | 123,104,070.23 | 100.13% |
| 601006 | 大秦铁路 | 118,882,124.89 | 96.70%  |
| 601628 | 中国人寿 | 107,558,050.36 | 87.49%  |
| 600019 | 宝钢股份 | 103,347,054.46 | 84.06%  |

|        |       |               |        |
|--------|-------|---------------|--------|
| 002128 | 露天煤业  | 97,794,199.36 | 79.54% |
| 600884 | 杉杉股份  | 91,423,426.99 | 74.36% |
| 601111 | 中国国航  | 89,403,952.81 | 72.72% |
| 600436 | 片仔癀   | 83,816,444.75 | 68.18% |
| 000069 | 华侨城 A | 80,769,705.40 | 65.70% |
| 600026 | 中海发展  | 76,831,303.43 | 62.49% |
| 601328 | 交通银行  | 76,342,380.90 | 62.10% |
| 600896 | 中海海盛  | 75,634,029.45 | 61.52% |
| 601166 | 兴业银行  | 75,443,054.82 | 61.36% |
| 601919 | 中国远洋  | 69,908,056.97 | 56.86% |
| 600050 | 中国联通  | 68,509,390.86 | 55.72% |
| 600900 | 长江电力  | 67,694,435.38 | 55.06% |
| 000960 | 锡业股份  | 66,064,964.72 | 53.74% |
| 600717 | 天津港   | 62,958,038.48 | 51.21% |
| 000522 | 白云山 A | 62,100,467.95 | 50.51% |
| 000002 | 万科 A  | 60,079,474.14 | 48.87% |
| 600787 | 中储股份  | 58,663,908.71 | 47.72% |
| 600009 | 上海机场  | 55,668,116.12 | 45.28% |
| 600489 | 中金黄金  | 49,064,376.16 | 39.91% |
| 600153 | 建发股份  | 47,917,687.16 | 38.98% |
| 600016 | 民生银行  | 45,584,817.62 | 37.08% |
| 600966 | 博汇纸业  | 44,546,519.77 | 36.23% |
| 600872 | 中炬高新  | 43,492,031.85 | 35.38% |
| 601398 | 工商银行  | 42,925,751.92 | 34.92% |
| 000623 | 吉林敖东  | 41,761,570.79 | 33.97% |
| 600005 | 武钢股份  | 41,563,933.54 | 33.81% |
| 000709 | 唐钢股份  | 38,735,761.52 | 31.51% |
| 000758 | 中色股份  | 36,652,528.63 | 29.81% |
| 600017 | 日照港   | 35,625,701.18 | 28.98% |
| 000655 | 金岭矿业  | 34,877,594.91 | 28.37% |
| 600162 | 香江控股  | 34,742,149.24 | 28.26% |
| 600048 | 保利地产  | 33,919,501.85 | 27.59% |
| 601857 | 中国石油  | 33,438,477.40 | 27.20% |
| 000755 | 山西三维  | 32,008,158.08 | 26.04% |
| 600000 | 浦发银行  | 25,621,154.78 | 20.84% |
| 002010 | 传化股份  | 23,447,695.79 | 19.07% |
| 000858 | 五粮液   | 23,383,202.20 | 19.02% |
| 600428 | 中远航运  | 23,254,885.86 | 18.92% |
| 000933 | 神火股份  | 22,987,210.14 | 18.70% |
| 000968 | 煤气化   | 22,633,305.77 | 18.41% |
| 600684 | 珠江实业  | 22,194,587.79 | 18.05% |
| 600755 | 厦门国贸  | 22,171,678.50 | 18.03% |

|        |        |               |        |
|--------|--------|---------------|--------|
| 600697 | 欧亚集团   | 19,583,292.90 | 15.93% |
| 600596 | 新安股份   | 19,367,668.25 | 15.75% |
| 000848 | 承德露露   | 19,301,966.52 | 15.70% |
| 600675 | 中华企业   | 19,039,423.54 | 15.49% |
| 600426 | 华鲁恒升   | 18,150,935.25 | 14.76% |
| 600416 | 湘电股份   | 18,015,287.29 | 14.65% |
| 600887 | 伊利股份   | 17,333,467.08 | 14.10% |
| 000888 | 峨眉山 A  | 17,070,936.50 | 13.89% |
| 600309 | 烟台万华   | 16,717,888.93 | 13.60% |
| 000061 | 农产品    | 16,693,405.02 | 13.58% |
| 000657 | 中钨高新   | 16,453,268.97 | 13.38% |
| 000825 | 太钢不锈   | 16,326,495.24 | 13.28% |
| 000800 | 一汽轿车   | 15,958,679.33 | 12.98% |
| 600352 | 浙江龙盛   | 15,904,883.04 | 12.94% |
| 600054 | 黄山旅游   | 15,592,173.66 | 12.68% |
| 600895 | 张江高科   | 14,958,627.37 | 12.17% |
| 000878 | 云南铜业   | 14,813,988.45 | 12.05% |
| 600795 | 国电电力   | 13,995,072.65 | 11.38% |
| 600748 | 上实发展   | 13,651,070.76 | 11.10% |
| 000024 | 招商地产   | 13,503,063.69 | 10.98% |
| 600600 | 青岛啤酒   | 13,483,758.84 | 10.97% |
| 000837 | 秦川发展   | 13,307,242.85 | 10.82% |
| 000759 | 武汉中百   | 13,056,698.07 | 10.62% |
| 600655 | 豫园商城   | 12,996,143.67 | 10.57% |
| 600527 | 江南高纤   | 12,590,557.01 | 10.24% |
| 002153 | 石基信息   | 12,387,214.35 | 10.08% |
| 601939 | 建设银行   | 12,382,298.00 | 10.07% |
| 000598 | 蓝星清洗   | 11,974,751.01 | 9.74%  |
| 600570 | 恒生电子   | 11,699,001.60 | 9.52%  |
| 600879 | 火箭股份   | 10,368,934.23 | 8.43%  |
| 600125 | 铁龙物流   | 10,269,556.32 | 8.35%  |
| 601600 | 中国铝业   | 9,851,289.79  | 8.01%  |
| 601390 | 中国中铁   | 9,666,897.60  | 7.86%  |
| 600415 | 小商品城   | 9,235,488.62  | 7.51%  |
| 000568 | 泸州老窖   | 9,204,706.70  | 7.49%  |
| 600886 | 国投电力   | 9,074,084.21  | 7.38%  |
| 600320 | 振华港机   | 8,980,625.45  | 7.30%  |
| 600396 | 金山股份   | 8,385,645.79  | 6.82%  |
| 000869 | 张裕 A   | 8,362,191.76  | 6.80%  |
| 600828 | *ST 成商 | 8,165,762.68  | 6.64%  |
| 600535 | 天士力    | 8,007,657.20  | 6.51%  |
| 000900 | 现代投资   | 7,360,506.04  | 5.99%  |

|        |       |              |       |
|--------|-------|--------------|-------|
| 000537 | 广宇发展  | 7,187,998.26 | 5.85% |
| 600123 | 兰花科创  | 6,930,677.42 | 5.64% |
| 000895 | 双汇发展  | 6,838,023.77 | 5.56% |
| 600121 | 郑州煤电  | 6,829,110.15 | 5.55% |
| 000762 | 西藏矿业  | 6,656,836.00 | 5.41% |
| 600519 | 贵州茅台  | 6,245,108.48 | 5.08% |
| 000999 | S 三 九 | 5,850,976.08 | 4.76% |
| 000619 | 海螺型材  | 5,806,755.57 | 4.72% |
| 600029 | 南方航空  | 5,648,475.07 | 4.59% |
| 600087 | 南京水运  | 5,568,468.91 | 4.53% |
| 600015 | 华夏银行  | 5,529,187.00 | 4.50% |
| 000031 | 中粮地产  | 5,382,242.66 | 4.38% |
| 600082 | 海泰发展  | 5,166,541.26 | 4.20% |
| 000089 | 深圳机场  | 5,107,245.96 | 4.15% |
| 000602 | 金马集团  | 5,077,710.60 | 4.13% |
| 000043 | 中航地产  | 5,068,347.82 | 4.12% |
| 600810 | 神马实业  | 4,996,477.52 | 4.06% |
| 600393 | 东华实业  | 4,955,569.08 | 4.03% |
| 000926 | 福星股份  | 4,927,466.90 | 4.01% |
| 600325 | 华发股份  | 4,822,861.60 | 3.92% |
| 000973 | 佛塑股份  | 4,638,468.88 | 3.77% |
| 601333 | 广深铁路  | 4,590,004.34 | 3.73% |
| 002111 | 威海广泰  | 4,473,120.59 | 3.64% |
| 000822 | 山东海化  | 4,428,511.14 | 3.60% |
| 600607 | 上实医药  | 4,388,061.66 | 3.57% |
| 601866 | 中海集运  | 4,193,538.30 | 3.41% |
| 600189 | 吉林森工  | 4,017,399.80 | 3.27% |
| 002069 | 獐 子 岛 | 3,885,831.65 | 3.16% |
| 000793 | 华闻传媒  | 3,665,784.04 | 2.98% |
| 000919 | 金陵药业  | 3,610,751.73 | 2.94% |
| 600555 | 九龙山   | 3,562,427.24 | 2.90% |
| 600122 | 宏图高科  | 3,454,707.42 | 2.81% |
| 600589 | 广东榕泰  | 3,441,536.12 | 2.80% |
| 000060 | 中金岭南  | 3,398,662.61 | 2.76% |
| 600258 | 首旅股份  | 3,310,472.62 | 2.69% |
| 600660 | 福耀玻璃  | 3,272,430.90 | 2.66% |
| 600307 | 酒钢宏兴  | 3,230,871.53 | 2.63% |
| 600066 | 宇通客车  | 3,154,359.35 | 2.57% |
| 000531 | 穗恒运 A | 3,146,455.95 | 2.56% |
| 600177 | 雅戈尔   | 3,139,592.10 | 2.55% |
| 600963 | 岳阳纸业  | 3,108,152.32 | 2.53% |
| 000768 | 西飞国际  | 3,097,179.12 | 2.52% |

|        |      |              |       |
|--------|------|--------------|-------|
| 000559 | 万向钱潮 | 2,997,784.37 | 2.44% |
| 000616 | 亿城股份 | 2,876,639.66 | 2.34% |
| 600993 | 马应龙  | 2,775,898.26 | 2.26% |
| 000088 | 盐田港  | 2,699,277.87 | 2.20% |
| 601601 | 中国太保 | 2,682,720.00 | 2.18% |
| 600446 | 金证股份 | 2,613,445.30 | 2.13% |
| 600253 | 天方药业 | 2,590,685.34 | 2.11% |
| 000513 | 丽珠集团 | 2,589,969.14 | 2.11% |
| 000961 | 大连金牛 | 2,572,110.85 | 2.09% |
| 000718 | 苏宁环球 | 2,459,888.46 | 2.00% |

## 2、累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

| 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额（元）   | 占期初净值比例 |
|--------|------|---------------|---------|
| 600884 | 杉杉股份 | 90,939,535.42 | 73.97%  |
| 600896 | 中海海盛 | 86,343,590.93 | 70.23%  |
| 600028 | 中国石化 | 82,850,287.27 | 67.39%  |
| 601166 | 兴业银行 | 78,333,730.75 | 63.72%  |
| 600219 | 南山铝业 | 74,644,376.22 | 60.71%  |
| 000002 | 万科A  | 53,315,523.15 | 43.37%  |
| 000755 | 山西三维 | 51,862,023.85 | 42.18%  |
| 600872 | 中炬高新 | 50,649,628.47 | 41.20%  |
| 600016 | 民生银行 | 50,362,956.13 | 40.96%  |
| 600036 | 招商银行 | 47,126,956.31 | 38.33%  |
| 601398 | 工商银行 | 44,834,850.70 | 36.47%  |
| 000690 | 宝新能源 | 43,650,456.06 | 35.50%  |
| 600900 | 长江电力 | 42,142,049.55 | 34.28%  |
| 600428 | 中远航运 | 39,175,635.44 | 31.86%  |
| 000623 | 吉林敖东 | 38,475,748.33 | 31.30%  |
| 000709 | 唐钢股份 | 36,351,230.63 | 29.57%  |
| 000069 | 华侨城A | 34,183,535.66 | 27.80%  |
| 000858 | 五粮液  | 32,350,997.35 | 26.31%  |
| 600019 | 宝钢股份 | 31,725,609.35 | 25.81%  |
| 000655 | 金岭矿业 | 30,639,784.20 | 24.92%  |
| 600755 | 厦门国贸 | 30,329,627.78 | 24.67%  |
| 600162 | 香江控股 | 29,940,692.45 | 24.35%  |
| 601006 | 大秦铁路 | 29,322,769.56 | 23.85%  |
| 000960 | 锡业股份 | 27,948,833.29 | 22.73%  |
| 600675 | 中华企业 | 26,789,728.49 | 21.79%  |
| 600787 | 中储股份 | 26,288,056.46 | 21.38%  |
| 600655 | 豫园商城 | 26,135,361.63 | 21.26%  |
| 601088 | 中国神华 | 26,127,844.00 | 21.25%  |
| 002010 | 传化股份 | 25,771,108.32 | 20.96%  |
| 000933 | 神火股份 | 25,228,229.37 | 20.52%  |

|        |       |               |        |
|--------|-------|---------------|--------|
| 600684 | 珠江实业  | 25,133,099.61 | 20.44% |
| 600000 | 浦发银行  | 24,786,450.10 | 20.16% |
| 600030 | 中信证券  | 21,905,386.88 | 17.82% |
| 600895 | 张江高科  | 21,158,096.62 | 17.21% |
| 600489 | 中金黄金  | 20,307,421.23 | 16.52% |
| 600416 | 湘电股份  | 19,980,931.21 | 16.25% |
| 000848 | 承德露露  | 19,696,943.20 | 16.02% |
| 000968 | 煤气化   | 19,134,158.53 | 15.56% |
| 600887 | 伊利股份  | 18,808,987.83 | 15.30% |
| 601600 | 中国铝业  | 18,785,547.94 | 15.28% |
| 000825 | 太钢不锈  | 18,412,382.47 | 14.98% |
| 000657 | 中钨高新  | 18,405,351.90 | 14.97% |
| 600795 | 国电电力  | 16,762,539.42 | 13.63% |
| 601628 | 中国人寿  | 15,440,989.39 | 12.56% |
| 600570 | 恒生电子  | 15,095,460.52 | 12.28% |
| 000800 | 一汽轿车  | 14,936,099.74 | 12.15% |
| 002128 | 露天煤业  | 14,752,441.21 | 12.00% |
| 600527 | 江南高纤  | 14,387,790.37 | 11.70% |
| 601857 | 中国石油  | 14,240,101.32 | 11.58% |
| 000598 | 蓝星清洗  | 13,994,315.21 | 11.38% |
| 600748 | 上实发展  | 13,962,977.54 | 11.36% |
| 000759 | 武汉中百  | 13,317,781.79 | 10.83% |
| 000837 | 秦川发展  | 13,303,271.69 | 10.82% |
| 600009 | 上海机场  | 13,275,018.93 | 10.80% |
| 601939 | 建设银行  | 13,270,958.74 | 10.79% |
| 000024 | 招商地产  | 12,546,967.67 | 10.21% |
| 600123 | 兰花科创  | 12,353,866.32 | 10.05% |
| 000089 | 深圳机场  | 12,142,789.24 | 9.88%  |
| 600048 | 保利地产  | 11,739,391.14 | 9.55%  |
| 000061 | 农产品   | 11,557,903.06 | 9.40%  |
| 600886 | 国投电力  | 10,784,098.51 | 8.77%  |
| 000878 | 云南铜业  | 10,702,055.20 | 8.70%  |
| 600320 | 振华港机  | 9,696,283.42  | 7.89%  |
| 000568 | 泸州老窖  | 9,667,448.15  | 7.86%  |
| 600125 | 铁龙物流  | 9,556,987.83  | 7.77%  |
| 600879 | 火箭股份  | 9,452,572.81  | 7.69%  |
| 600963 | 岳阳纸业  | 8,953,075.29  | 7.28%  |
| 000869 | 张裕A   | 8,362,332.86  | 6.80%  |
| 601111 | 中国国航  | 8,190,029.64  | 6.66%  |
| 000537 | 广宇发展  | 8,099,665.17  | 6.59%  |
| 600828 | *ST成商 | 8,068,436.96  | 6.56%  |
| 000900 | 现代投资  | 7,652,185.03  | 6.22%  |

|        |       |              |       |
|--------|-------|--------------|-------|
| 600396 | 金山股份  | 7,418,537.67 | 6.03% |
| 600121 | 郑州煤电  | 6,970,375.87 | 5.67% |
| 000895 | 双汇发展  | 6,958,096.72 | 5.66% |
| 600519 | 贵州茅台  | 6,742,446.22 | 5.48% |
| 600393 | 东华实业  | 6,694,849.78 | 5.45% |
| 000602 | 金马集团  | 6,609,892.19 | 5.38% |
| 000031 | 中粮地产  | 6,495,927.79 | 5.28% |
| 000039 | 中集集团  | 6,341,548.21 | 5.16% |
| 600810 | 神马实业  | 6,332,077.02 | 5.15% |
| 600415 | 小商品城  | 6,200,893.00 | 5.04% |
| 600426 | 华鲁恒升  | 6,150,178.15 | 5.00% |
| 000619 | 海螺型材  | 5,995,006.88 | 4.88% |
| 600269 | 赣粤高速  | 5,978,152.58 | 4.86% |
| 000999 | S 三 九 | 5,975,178.02 | 4.86% |
| 600082 | 海泰发展  | 5,942,282.65 | 4.83% |
| 600585 | 海螺水泥  | 5,904,948.96 | 4.80% |
| 000522 | 白云山 A | 5,824,205.11 | 4.74% |
| 000973 | 佛塑股份  | 5,678,955.33 | 4.62% |
| 600607 | 上实医药  | 5,588,633.03 | 4.55% |
| 000926 | 福星股份  | 5,582,568.09 | 4.54% |
| 600325 | 华发股份  | 5,574,072.93 | 4.53% |
| 600087 | 南京水运  | 5,542,352.77 | 4.51% |
| 600596 | 新安股份  | 5,482,266.14 | 4.46% |
| 600029 | 南方航空  | 5,293,844.76 | 4.31% |
| 601333 | 广深铁路  | 5,291,285.03 | 4.30% |
| 600026 | 中海发展  | 5,215,883.30 | 4.24% |
| 600015 | 华夏银行  | 4,938,700.17 | 4.02% |
| 600258 | 首旅股份  | 4,902,862.65 | 3.99% |
| 002111 | 威海广泰  | 4,886,953.29 | 3.97% |
| 000762 | 西藏矿业  | 4,695,970.02 | 3.82% |
| 000822 | 山东海化  | 4,574,926.23 | 3.72% |
| 600535 | 天士力   | 4,308,569.04 | 3.50% |
| 000043 | 中航地产  | 4,286,456.81 | 3.49% |
| 000793 | 华闻传媒  | 4,204,988.38 | 3.42% |
| 002069 | 獐 子 岛 | 4,117,898.12 | 3.35% |
| 000919 | 金陵药业  | 3,914,250.83 | 3.18% |
| 600555 | 九龙山   | 3,782,185.73 | 3.08% |
| 600005 | 武钢股份  | 3,687,762.20 | 3.00% |
| 600122 | 宏图高科  | 3,535,081.97 | 2.88% |
| 600436 | 片仔癀   | 3,518,741.37 | 2.86% |
| 600589 | 广东榕泰  | 3,471,619.00 | 2.82% |
| 000060 | 中金岭南  | 3,451,403.23 | 2.81% |

|        |       |              |       |
|--------|-------|--------------|-------|
| 000768 | 西飞国际  | 3,349,039.20 | 2.72% |
| 600177 | 雅戈尔   | 3,279,277.46 | 2.67% |
| 000531 | 穗恒运 A | 3,206,383.48 | 2.61% |
| 600050 | 中国联通  | 3,065,825.22 | 2.49% |
| 600993 | 马应龙   | 3,054,347.00 | 2.48% |
| 000616 | 亿城股份  | 3,039,080.85 | 2.47% |
| 601318 | 中国平安  | 2,975,766.79 | 2.42% |
| 600066 | 宇通客车  | 2,933,170.07 | 2.39% |
| 000513 | 丽珠集团  | 2,849,254.46 | 2.32% |
| 600307 | 酒钢宏兴  | 2,820,285.87 | 2.29% |
| 600230 | 沧州大化  | 2,803,020.55 | 2.28% |
| 600253 | 天方药业  | 2,786,789.41 | 2.27% |
| 000006 | 深振业 A | 2,710,472.22 | 2.20% |
| 002155 | 辰州矿业  | 2,704,917.59 | 2.20% |
| 000559 | 万向钱潮  | 2,651,586.10 | 2.16% |
| 601168 | 西部矿业  | 2,586,090.53 | 2.10% |
| 000961 | 大连金牛  | 2,572,831.99 | 2.09% |
| 600825 | 新华传媒  | 2,497,041.34 | 2.03% |
| 002142 | 宁波银行  | 2,495,697.47 | 2.03% |
| 000088 | 盐田港   | 2,494,224.87 | 2.03% |
| 600054 | 黄山旅游  | 2,480,356.24 | 2.02% |

3、报告期内买入股票的成本总额为 4,527,492,895.02 元，卖出股票的收入总额为 2,323,318,813.29 元。

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

| 券种   | 期末市值（元）       | 市值占净值比例 |
|------|---------------|---------|
| 央行票据 | 97,410,000.00 | 2.78%   |
| 合计   | 97,410,000.00 | 2.78%   |

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

| 债券名称        | 期末市值（元）       | 市值占净值比例 |
|-------------|---------------|---------|
| 07 央票 141   | 39,668,000.00 | 1.13%   |
| 07 央行票据 139 | 38,448,000.00 | 1.10%   |
| 07 央行票据 94  | 19,294,000.00 | 0.55%   |

(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，或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、报告期内本基金未投资控股股东主承销的证券，未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证，投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的

规定。

#### 4、其他资产的构成

| 序号 | 资产科目名称 | 金额（元）         |
|----|--------|---------------|
| 1  | 存出保证金  | 1,574,225.86  |
| 2  | 证券清算款  | 4,870,577.02  |
| 3  | 应收利息   | 356,123.21    |
| 4  | 应收申购款  | 5,110,070.05  |
| 合计 |        | 11,910,996.14 |

5、截至 2007 年 12 月 31 日，本基金未持有处于转股期的可转债

#### 6、报告期内因分离交易可转债而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  | 580012 | 云化 CWB1 | 12,636    | 74,819.02 |

以上权证本报告期内已全部卖出。

#### 7、本报告期内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 | 400,000   | 3,094,608.23 |
| 2  | 031001 | 侨城 HQC1 | 150,000   | 7,641,862.80 |

以上权证本报告期内全部行权。

## 八、基金份额持有人户数、持有人结构

#### （一）报告期末基金份额持有人户数

|               |           |
|---------------|-----------|
| 基金份额持有人户数（户）  | 101,062   |
| 平均每户持有基金份额（份） | 16,159.38 |

#### （二）报告期末基金持有人结构

| 投资者类型 | 持有份额（份）          | 占总份额的比例 |
|-------|------------------|---------|
| 机构投资者 | 96,941,041.05    | 5.94%   |
| 个人投资者 | 1,536,157,764.40 | 94.06%  |
| 合计    | 1,633,098,805.45 | 100%    |

#### （三）报告期末基金场内前十名持有人明细

|    |       |      |      |      |
|----|-------|------|------|------|
| 序号 | 持有人名称 | 持有份额 | 占场内总 | 占期末总 |
|----|-------|------|------|------|

|    |                            |           | 份额比例  | 份额比例  |
|----|----------------------------|-----------|-------|-------|
| 1  | 贾晶                         | 2,225,230 | 1.45% | 0.14% |
| 2  | 徐祥臣                        | 2,117,169 | 1.38% | 0.13% |
| 3  | 邓秀华                        | 2,000,000 | 1.31% | 0.12% |
| 4  | 合众人寿保险股份有限公司—传<br>统一普通保险产品 | 1,242,600 | 0.81% | 0.08% |
| 5  | 李晶                         | 920,396   | 0.60% | 0.06% |
| 6  | 周世英                        | 862,388   | 0.56% | 0.05% |
| 7  | 张琦波                        | 800,000   | 0.52% | 0.05% |
| 8  | 金德增                        | 760,650   | 0.50% | 0.05% |
| 9  | 大连大雪啤酒股份有限公司               | 748,622   | 0.49% | 0.05% |
| 10 | 张丽霞                        | 732,621   | 0.48% | 0.04% |

## (四) 基金管理公司从业人员投资本基金的情况

| 项目                     | 期末持有本开放式基金<br>份额的总量（份） | 占本基金总份额的比例 |
|------------------------|------------------------|------------|
| 基金管理公司持有本<br>基金的所有从业人员 | 1, 190, 337. 26        | 0. 0729%   |

## 九、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：101, 749, 373. 62 份

(2) 报告期期末基金份额总额：1, 633, 098, 805. 45 份

(3) 报告期间基金总申购份额：2, 934, 839, 621. 45 份

(4) 报告期间基金总赎回份额：1, 403, 490, 189. 62 份

## 十、重大事件揭示

(一) 报告期内基金管理人、基金托管人未召开基金份额持有人大会。

(二) 报告期内基金管理人、基金托管人的基金托管部门未有重大人事变动。

(三) 本年度无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四) 报告期内本基金的投资策略未有重大改变。

(五) 本年度本基金共进行了 1 次收益分配, 分配金额为 62,748,238.67 元。

(六) 本报告期内本基金支付给聘任会计师事务所--普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 60,000.00 元。目前普华永道中天会计师事务所有限公司已向本基金提供连续两年的审计服务。

(七) 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的情形。

(八) 本年度基金租用证券公司专用交易单元的有关情况

#### 1、股票交易情况

| 券商简称 | 席位 | 买卖股票成交量          |          | 计提佣金         |            |
|------|----|------------------|----------|--------------|------------|
|      | 数量 | 成交金额             | 占本期成交量比例 | 佣金           | 占计提佣金总额的比例 |
|      |    | 人民币元             |          | 人民币元         |            |
| 远东证券 | 1  | 689,678,199.98   | 10.20%   | 565,533.77   | 10.34%     |
| 世纪证券 | 1  | 727,286,064.62   | 10.75%   | 596,372.08   | 10.90%     |
| 金元证券 | 1  | 924,945,910.00   | 13.67%   | 758,452.66   | 13.86%     |
| 湘财证券 | 1  | 857,001,502.55   | 12.67%   | 670,607.87   | 12.26%     |
| 东海证券 | 1  | 728,972,896.95   | 10.78%   | 597,755.03   | 10.92%     |
| 中信证券 | 1  | 612,307,848.94   | 9.05%    | 479,135.28   | 8.76%      |
| 联合证券 | 1  | 306,043,692.70   | 4.52%    | 250,955.17   | 4.59%      |
| 国金证券 | 1  | 315,965,418.66   | 4.67%    | 247,244.78   | 4.52%      |
| 中投证券 | 1  | 600,856,687.78   | 8.88%    | 492,698.82   | 9.00%      |
| 国海证券 | 1  | 792,073,977.92   | 11.71%   | 649,497.48   | 11.87%     |
| 招商证券 | 1  | 149,061,797.72   | 2.20%    | 116,642.36   | 2.13%      |
| 巨田证券 | 1  | 60,017,473.56    | 0.89%    | 46,963.80    | 0.86%      |
| 合计   | 12 | 6,764,211,471.38 | 100.00%  | 5,471,859.10 | 100.00%    |

#### 2、债券及回购交易情况

| 券商简称 | 席位 | 买卖债券成交量    |          | 债券回购成交量 |          |
|------|----|------------|----------|---------|----------|
|      | 数量 | 成交金额       | 占本期成交量比例 | 成交金额    | 占本期成交量比例 |
|      |    | 人民币元       |          | 人民币元    |          |
| 远东证券 | 1  | —          | —        | —       | —        |
| 世纪证券 | 1  | 183,469.60 | 2.13%    | —       | —        |
| 金元证券 | 1  | —          | —        | —       | —        |
| 湘财证券 | 1  | —          | —        | —       | —        |
| 东海证券 | 1  | —          | —        | —       | —        |

|      |    |              |         |   |   |
|------|----|--------------|---------|---|---|
| 中信证券 | 1  | 4,039,498.60 | 46.98%  | - | - |
| 联合证券 | 1  | 1,489,026.00 | 17.32%  | - | - |
| 国金证券 | 1  | -            | -       | - | - |
| 中投证券 | 1  | -            | -       | - | - |
| 国海证券 | 1  | 2,887,200.80 | 33.58%  | - | - |
| 招商证券 | 1  | -            | -       | - | - |
| 巨田证券 | 1  | -            | -       | - | - |
| 合计   | 12 | 8,599,195.00 | 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 |
|------|------|---------------|---------|
| 远东证券 | 1    | 2,321,895.22  | 17.78%  |
| 世纪证券 | 1    | -             | -       |
| 金元证券 | 1    | 3,094,368.47  | 23.70%  |
| 湘财证券 | 1    | -             | -       |
| 东海证券 | 1    | -             | -       |
| 中信证券 | 1    | -             | -       |
| 联合证券 | 1    | -             | -       |
| 国金证券 | 1    | 7,641,862.80  | 58.52%  |
| 中投证券 | 1    | -             | -       |
| 国海证券 | 1    | -             | -       |
| 招商证券 | 1    | -             | -       |
| 巨田证券 | 1    | -             | -       |
| 合计   | 12   | 13,058,126.49 | 100.00% |

## 4、交易单元租用及变更情况

本基金在报告期内新增 8 家证券公司的 8 个交易单元：招商证券（1 个深圳交易单元）、东海证券（1 个上海交易单元）、中信证券（1 个深圳交易单元）、联合证券（1 个上海交易单元）、国金证券（1 个深圳交易单元）、中投证券（1 个上海交易单元）、国海证券（1 个上海交易单元）、国信证券（1 个上海交易单元）。

本基金在报告期内终止 1 家证券公司的 2 个交易单元：巨田证券（1 个上海交易单元、1 个深圳交易单元）。

## 5、专用交易单元的选择标准和程序

（1）实力雄厚，信誉良好。

（2）财务状况良好，经营行为规范。

（3）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基

金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

(5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作券商。基金管理人与被选择的证券经营机构签订《专用证券交易单元租用协议》，报证券交易所办理交易单元相关租用手续。

#### (九) 报告期内发生的其它重要事项

1、2007 年 1 月 17 日在《上海证券报》、《证券时报》上公告了《巨田基金管理有限公司关于调整最低赎回份额的公告》。

2、2007 年 2 月 7 日在《上海证券报》、《证券时报》上公告了《巨田基金管理有限公司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》。

3、2007 年 3 月 19 日在《中国证券报》上公告了《巨田资源优选混合型证券投资基金第七次分红预告》。

4、2007 年 3 月 26 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告了《巨田基金管理有限公司关于旗下基金申购费率优惠活动的公告》。

5、2007 年 3 月 29 日在《中国证券报》上公告了《关于巨田资源优选混合型证券投资基金调整分红金额的公告》。

6、2007 年 3 月 30 日在《中国证券报》上公告了《巨田资源优选混合型证券投资基金第七次分红公告》。

7、2007 年 4 月 24 日在《上海证券报》、《证券时报》上公告了《巨田基金管理有限公司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》。

8、2007 年 4 月 28 日在《中国证券报》、《证券时报》上公告了《巨田基金管理有限公司关于旗下基金申购费率优惠活动截止的公告》。

9、2007 年 5 月 22 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告了《巨田基金管理有限公司关于网上交易系统开通中国建设银行网上支付的公告》。

10、2007 年 5 月 26 日在《上海证券报》、《证券时报》上公告了《巨田基金管理有限公司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》。

11、2007 年 6 月 29 日在《中国证券报》上公告了《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》。

12、2007 年 7 月 5 日在《中国证券报》上公告了《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告》。

13、2007 年 8 月 3 日在《证券时报》、《中国证券报》上公告了《巨田基金管理有限公司旗下基金关于参加兴业证券股份有限公司网上申购费率优惠活动的公告》。

14、2007 年 8 月 31 日在《中国证券报》和《上海证券报》上公告了《关于巨田资源优选混合型证券投资基金和巨田货币市场基金增加代销机构的公告》。

15、2007 年 9 月 7 日在《证券时报》、《中国证券报》上公告了《巨田基金管理有限公司关于调整最低保留份额的公告》。

16、2007 年 9 月 26 日在《中国证券报》上公告了《关于巨田资源优选混合型证券投资基金增加代销机构的公告》。

17、2007 年 9 月 29 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告了《巨田基金管理有限公司关于修改旗下基金合同及托管协议的公告》。

18、2007 年 10 月 9 日在《中国证券报》上公告了《关于巨田资源优选基金参与交通银行定期定投推广活动的公告》。

19、2007 年 10 月 17 日在《证券时报》、《中国证券报》上公告了《巨田基金管理有限公司关于旗下基金参与海通证券网上交易费率优惠活动的公告》。

20、2007 年 10 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》上公告了《关于巨田资源优选混合型证券投资基金和巨田货币市场基金增加代销机构的公告》。

21、2007 年 12 月 13 日在《证券时报》、《中国证券报》上公告了《巨田基金管理有限公司关于旗下基金参与湘财证券网上交易费率优惠活动的公告》。

22、2007 年 12 月 14 日在《证券时报》、《中国证券报》上公告了《巨田基金管理有限公司关于旗下基金参与银河证券网上交易费率优惠活动的公告》。

23、2007 年 12 月 18 日在《证券时报》、《中国证券报》上公告了《巨田基金管理有限公司旗下基金通过中国光大银行开办基金定投业务的公告》。

## 十一、备查文件目录

### （一）备查文件清单

- 1、中国证监会核准巨田资源优选混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《巨田资源优选混合型证券投资基金基金合同(LOF)》；
- 3、《巨田资源优选混合型证券投资基金托管协议(LOF)》；
- 4、《巨田资源优选混合型证券投资基金招募说明书(LOF)》；
- 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

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，还可以通过基金管理人网站查阅或下载。

（巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）2007 年年度报告 此页以下无正文）

（巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）2007 年年度报告 此页无正文）

巨田基金管理有限公司

2008 年 3 月 28 日