巨田货币市场基金

招募说明书摘要(更新)

（2007 年第 1 号）

基金管理人:巨田基金管理有限公司　　基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示

巨田货币市场基金（以下简称“本基金”）经 2006 年 6 月 15 日中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】120 号文《关于同意巨田货币市场基金募集的批复》核准募集。本基金的基金合同于 2006 年 8 月 17 日正式生效。本基金为契约型开放式。

投资有风险,投资者投资于本基金前应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书摘要（更新）所载内容截止日为 2007 年 2 月 17 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 12 月 31 日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称:巨田基金管理有限公司
住所:深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层
办公地址:深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 层
法定代表人:王一楠
成立时间:2003 年 3 月 14 日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2003]33 号
经营范围:基金管理和发起设立基金
注册资本:1 亿元人民币
组织形式:有限责任公司
存续期间:50 年
全国统一客服电话:400–8888–668
电话:（0755）82993636
传真:（0755）82990384
联系人:李锦

股东及股权结构:巨田证券有限责任公司,35%;中信国安信息产业股份有限公司,35%;汉唐证券有限责任公司,15%;深圳市招融投资控股有限公司,10%;浙江中大集团控股有限公司,5%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

王一楠先生,硕士。1998 年至今任巨田证券有限责任公司董事长,历任国家统计局投资司副司长,华能财务公司总经理,中国华能集团副总经理。现任本公司董事长。

秦永忠先生,中央财政金融学院毕业,大学专科学历。2005 年 6 月至今任中信国安集团公司常务副总经理,历任北京国安足球集团财务部经理,中信国安总公司财务部经理,中信国安总公司综合计划部经理,中信国安信息产业股份有限公司副总经理、总经理、董事。现任本公司董事。

谢魁星先生,东北财经大学金融学硕士。2005 年 8 月起任招商局中国投资管理有限公司董事总经理。1992 年至 2005 年曾任招商证券股份有限公司风险管理部总经理、人力资源部总经理、研究发展中心总经理等职。现任本公司董事。

李润云先生,解放军第二外国语学院毕业,大学专科学历。1996 年至今任职浙江中大集团控股有限公司,现任浙江中大集团控股有限公司董事长,曾就职于浙江省粮油食品进出口公司,浙江国际贸易中心,浙江外经贸委。现任本公司董事。

韩巍先生,中国人民大学档案系、法律系学士。1995 年至今任北京市信利律师事务所律师、合伙人,曾就职于国家教育委员会办公厅、中国法律事务中心。现任本公司独立董事。

荆林波先生,中国社科院研究生院经济学博士。1998 年至今任中国社科院财贸经济研究所硕士生导师,现任中国社科院财贸经济研究所所长助理兼任信息服务与电子商务研究室主任。现任本公司独立董事。

何祚文先生,深圳市注协理事,培训委员会主任,证券资格注册会计师,注册税务师,厦门大学工商管理硕士。2002 年至今就职于中天华正会计师事务所,现任董事、副总经理、深圳所所长;曾就职于深圳华鹏会计师事务所。现任本公司独立董事。

王苏生先生,芝加哥大学 MBA、北京大学法学博士、清华大学经济管理学院博士后。2004 年至今任哈尔滨工业大学深圳研究生院,管理学教授、博士生导师、经济管理学科带头人、教授会主席。现任本公司独立董事。

许明先生,中南财经大学产业经济学博士。历任海南省证券公司武汉业务部副总经理,湖北中大集团有限公司总经理,三峡证券有限责任公司总裁办公室主任,研究所所长,北京营业部总经理,巨田证券有限公司北京总部副总经理,研究所副所长兼投资部总经理,巨田证券有限责任公司总经理助理,副总经理。现任本公司董事,总经理。

2、监事会成员

李玉霞女士,东北财经大学会计系学士,执业注册会计师资格。2005 年至今任巨田证券有限责任公司财务部总经理。曾就职于深圳市中诚会计师事务所。现任本公司监事长。

孙璐先生,首都经济贸易大学学士。2005 年 6 月至今任中信国安信息产业股份有限公司总经理,历任华夏证券公司东四营业部投资部经理,中信国安有限公司总经理助理、中信国安信息产业股份有限公司副总经理。现任本公司监事。

吕静女士,上海交通大学管理学院在读 EMBA。1999 年至今任浙江裕源投资有限公司总经理,浙江中大技术进出口集团有限公司副总经理。历任浙江华越公司财务经理,浙江技术进出口公司财务部经理。现任本公司监事。

白卫国先生,中南财经大学政法系学士。曾就职于三峡证券有限责任公司、亚洲证券有限责任公司,历任总裁办公室副主任、武汉青年路营业部总经理、北京和平里营业部总经理。2003 年起就职于本公司,曾任市场发展部副总监,现任市场发展部副总监。现任本公司监事。

张笑雪女士,北京大学光华管理学院、深圳证券交易所联合培养应用经济学博士后。曾就职于中国国际金融有限公司、巨田证券有限责任公司。2003 年起就职于本公司,现任金融工程部副总监。现任本公司监事。

3、公司高管人员

许明先生,总经理,简历同上。

尹军先生,中国社会科学院研究生院法学系研究生课程毕业。12 年证券从业经验,曾任北京第二汽车制造厂办公室副主任,北京轻型汽车有限公司党委副书记,中共北京市市委研究室正处级调研员,中国证监会北京证管办处长,巨田证券有限公司副总经理。现任本公司副总经理。

李锦女士,吉林大学经济管理学院国际金融专业硕士研究生。10 年证券从业经验。曾就职于巨田证券有限责任公司,历任交易管理总部综合管理部经理助理,总经理办公室主任助理,资产管理部理财部副经理、经理;2003 年起就职于本公司,曾任基金运营部副总监、总监,总经理助理兼基金运营部总监。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理简介

孙健先生,经济学硕士,七年证券从业经验。曾先后任湘财证券资产管理总部债券投资经理、太平人寿保险有限公司投资部投资经理、太平资产管理有限公司投资部投资经理,2006 年 6 月加入巨田基金管理有限公司,任巨田货币市场基金基金经理助理。2006 年 6 月起就职于本公司,曾任巨田货币市场基金基金经理助理。2007 年 1 月起任本公司本基金基金经理。

本基金历任基金经理:冀洪涛先生,任职时间自本基金合同生效起至 2007 年 1 月。

5、投资决策委员会成员

主任委员:许明先生,本公司董事、总经理。

委员:徐力中先生;冀洪涛先生,投资管理部副总监、巨田资源优选混合型证券投资基金基金经理;廖京胜先生,投资管理部副总监;王卫东先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1、基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司（简称:交通银行）
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:蒋超良
住所:上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码:200120
注册时间:1987 年 3 月 30 日
注册资本:458.04 亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25 号
联系人:张咏东
电话:021–68888917

交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行,自 1987 年重新组建以来,交通银行各项业务和机构建设持续健康发展,目前在我国 140 个大中城市设有分支行,全行员工近 6 万人。截至 2006 年末,资产总额为 17194.83 亿元人民币,实现净利润 122.74 亿元人民币。根据《银行家》杂志最新排名,交通银行按资产总额排名世界 1000 家大银行中第 73 位。2005 年 6 月 23 日,交通银行成功在香港主板市场上市,成为首家在境外上市的内地商业银行。1998 年被《欧洲货币》评为中国最佳银行,1999 年被《环球金融》评为中国最佳银行,2005 年被《金融亚洲》评为中国最佳银行。2006 年,由世界品牌实验室（WBL）举办的 2006 年第三届《Brand China 品牌中国》大型调查的调查结果,交通银行再次蝉联“中国品牌年度大奖（No.1）”（银行类）,同时荣获 2006 年“中国最具影响力品牌”（TOP 10）（银行类）排名第二,并获得 2006 年“中国十大诚信品牌”（唯一入选银行）。

交通银行总行设资产托管部,现有员工 80 余人。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,并具有经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

李军先生,交通银行行长,华中理工大学经济学硕士,高级经济师。曾任交通银行武汉分行副总经理、行长,交通银行总稽核、董事、常务董事、执行董事、副行长;2006 年 9 月担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生,交通银行副行长,主管交通银行资产托管业务,南开大学经济学博士,高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006 年 1 月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

阮红女士,交通银行资产托管部总经理,复旦大学企业管理专业博士研究生学历,高级经济师。具有近二十年银行金融从业经验,在银行经营管理方面具有丰富的理论与实践经验。曾任交通银行调研部副主任科员、交通银行办公室秘书处主任科员、交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、交通银行办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、党委委员,2006 年 1 月至今任交通银行资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止 2006 年底,交通银行共托管证券投资基金 35 只,包括普惠基金、安顺基金、汉兴基金、裕华基金、兴科基金、安久基金、科汇基金、科讯基金、久富基金、华安创新基金、科瑞基金、国泰金鹰增长基金、华夏债券基金、湘财合丰系列基金（成长、周期、稳定）、鹏华普天系列基金（债券、收益）、海富通精选基金、博时现金收益证券投资基金、易方达 50 指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、鹏华中国 50 开放式证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、富国天益价值证券投资基金、华安宝利证券投资基金、国联优质成长证券投资基金、银河银富货币市场证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、湘财风险预算混合型证券投资基金等基金、万家公用事业证券投资基金、天治核心成长股票型证券投资基金、汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金、巨田货币市场证券投资基金、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金。托管了 2 只 QFII 基金——日兴中国人民币国债母基金、日兴 AM 中国人民币 A 股母基金,同时交通银行也是全国社会保障基金两家托管行之一。托管总规模 1100 余亿元。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、巨田基金管理有限公司直销中心

（1）深圳
办公地址:深圳市福田区滨河大道 5020 号证券大厦 4 楼
电话:（0755）82990365、（0755）82993636–8608
传真:（0755）82990631
联系人:许菲菲
全国统一客服电话:400–8888–668(免长途费)、（0755）82990391

（2）北京
办公地址:北京市海淀区中关村南大街 1 号友谊宾馆雅园 64841 房间
电话:（010）68719599
传真:（010）68498316
联系人:赵春梅

（3）上海
办公地址:上海市浙江中路 400 号 11 楼 1128 室
电话:（021）51164408
传真:（021）51164408
联系人:周苑洁

2、代销机构

（1）交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人:蒋超良
电话:（021）58781234
传真:（021）58408842
联系人:曹榕
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

（2）中国银河证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:朱利
电话:（010）66568587
联系人:郭京华
网址:www.chinastock.com.cn

（3）中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:黎晓宏
联系人:魏明
开放式基金咨询电话:400–8888–108
开放式基金业务传真:（010）65182261
网址:www.csc108.com

（4）海通证券股份有限公司
地址: 上海市淮海中路 98 号
法定代表人:王开国
电话:（021）53594566
联系人:金芸
客户服务热线:（021）962503 或拨打各城市营业网点咨询电话
网址:www.htsec.com

（5）广发证券股份有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室
办公地址:广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼
法定代表人:王志伟
联系人:肖中梅
开放式基金咨询电话:（020）87555888 转各营业网点
开放式基金业务传真:（020）87557985
网址: http://www.gf.com.cn

（6）兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 99 号标力大厦
法定代表人:兰荣
电话:（021）68419974
传真:（021）68419867
联系人:杨盛芳
网址:www.xyzq.com.cn

（7）长江证券有限责任公司
注册地址:武汉市新华路特 8 号
法定代表人:胡运钊
联系人:甘露
电话:（021）63296362
传真:（021）51062920
客户服务热线:400–8888–999
网址:www.cz318.com.cn

（8）山西证券有限责任公司
注册地址:山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:吴晋安
电话:（0351）8686703
联系人:张治国
网址:www.i618.com.cn

（9）湘财证券有限责任公司
注册地址:长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
办公地址:上海市浦东银城东路 139 号华能联合大厦 5 层
法定代表人:陈学荣
联系人:陈伟
电话:（021）68634518–8613
开放式基金客服电话:（021）68865020
传真:（021）68865938
网址:www.xcsc.com

（10）天相投资顾问有限公司
注册地址:中国北京市朝阳区幸福村中路锦绣园 D 座三层
法定代表人:林义相
电话:（010）84533151 转 802、822
联系人:陈少震
网址: www.txsec.com

（11）金元证券有限责任公司
注册地址:海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层
办公地址:深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层
法定代表人:郑辉
电话:（0755）83025695
传真:（0755）83025625
联系人:金春
网址:www.jyzq.com.cn

（12）齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路 128 号
法定代表人:李玮
电话:（0531）82024184
传真:（0531）82024197
联系人:傅咏梅
网址:www.qlzq.com.cn

（13）国海证券有限责任公司
注册地址:中国广西南宁市滨湖路 46 号
办公地址:中国广西南宁市滨湖路 46 号
联系人:覃清芳
电话:（0771）5539262
传真:（0771）5539033
客服热线:400–8888–100（全国）、96100（广西）
公司网站:http://www.ghzq.com.cn

（14）国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路 618 号
办公地址:上海市延平路 135 号
法定代表人:祝幼一
客户服务电话:400–8888–666
传真:（021）62569400
联系人:芮敏祺
电话:（021）62580818–213
网址:www.gtja.com

（15）世纪证券有限责任公司
办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层
法定代表人:段强
联系人:章磊,刘军辉
电话:（0755）83199511
传真:（0755）83199545
网址:www.csco.com.cn

（16）国信证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦
法定代表人:何如
联系人:林建闽
电话:（0755）82130833
传真:（0755）82133302
网址:www.guosen.com.cn

（17）平安证券有限责任公司
办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人:叶黎成
联系人:余江、庄维佳
电话:（0755）82450826、（0755）22622287
传真:（0755）82433794
全国统一客户服务热线:95511
网址:www.pa18.com

(18) 民生证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室
办公地址:北京市朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室
法定代表人:岳献春
电话:（010）85252605
传真:（010）85252655
联系人:杨甦华
网址:www.mszq.com

（19）东莞证券有限责任公司
注册地址:广东省东莞市可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人:周建辉
热线电话:961130、（0769）2413222
联系人:童贻腾
电话:（0769）22119351
传真:（0769）22119426
网址:www.dgzq.com.cn

（20）广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市新天地大厦 8 层
法定代表人:王比
联系人:吴晓立
电话:（0591）87383623
传真:（0591）87383610
网址:www.gfhfzq.com.cn

（21）信泰证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市长江路 88 号
法定代表人:钱凯法
联系电话:(025)84784782
传真:(025)84784741
联系人:舒萌菲
网址:www.thope.com

（二）注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层
办公地址:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层
法定代表人:陈耀先
电话:（010）58598835
传真:（010）58598907
联系人:任瑞新

（三）律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层
负责人:王玲
电话:（010）58785588、（0755）82125533
联系人:冯艾
经办律师:宋萍萍、彭晋

（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604–1608 室
办公地址:上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
法人代表:杨绍信
联系人: 陈兆欣
联系电话:(021)61238888
经办注册会计师: 汪棣、陈宇

四、基金的名称

本基金名称:巨田货币市场基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

在力争本金安全和保证资产高流动性的前提下,追求高于业绩比较基准的收益率。

七、基金的投资方向

1、现金;
2、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单;
3、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券和资产支持证券;
4、期限在一年以内（含一年）的央行票据;
5、期限在一年以内（含一年）的债券回购;
6、短期融资券;
7、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

八、基金的投资策略

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定;
（2）国内外宏观经济形势、微观经济环境和证券市场走势;
（3）财政和货币政策变化、利率走势、通货膨胀预期;
（4）投资品种的预期收益率和风险水平。

2、决策程序

（1）研究人员对宏观经济指标、财政与货币政策、资金供需、品种结构等进行研究与分析,提交研究报告和投资建议,为投资运作提供决策支持;

（2）基金经理根据研究报告和对市场走势的判断,初步拟定资产配置方案;

（3）金融工程小组运用风险监测模型和风险监控指标,对投资组合进行风险测算;相关部门每日提供基金申购赎回的数据报告,供基金经理决策参考;

（4）投资决策委员会根据以上报告和方案,定期召开会议,确定投资组合的资产配置方案;

（5）基金经理按照投资决策委员会的决定,并考虑风险管理小组的风险管理建议和市场部的申购赎回预测,构建具体的投资组合并进行日常管理;

（6）投资组合和操作方案交由集中交易室执行。集中交易室根据基金经理的指令,制定交易策略并执行交易。交易情况及时反馈给基金经理;

（7）风险管理小组对投资组合跟踪评估,对风险隐患提出预警;监察稽核部对投资组合的执行过程进行实时风险监控。

3、投资组合管理的方法和标准

本基金主要为投资人提供短期现金管理工具,最主要的投资策略是,通过优化以久期为核心的资产配置和品种选择,在保证安全性和流动性的前提下,最大限度地提升基金资产的收益。投资策略分为两个层次:战略资产配置和战术资产配置。

战略资产配置:根据对宏观经济指标、国家财政与货币政策、资金供需、利率期限结构等因素的研究和分析,预测短期市场利率水平,从而确定投资组合的久期和品种配置。

战术资产配置:主要包括对交易市场、投资品种、投资时机、套利的选择与操作,并根据市场环境变化,寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会,努力实现超额收益。

九、业绩比较基准

一年期银行定期储蓄存款的税后利率 =（1– 利息税率）× 一年期银行定期储蓄存款利率。

本基金管理人在合理的市场化利率基准推出的情况下,可根据投资目标、投资方向和投资策略,确定变更业绩比较基准,并提前公告。

十、风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,预期风险和预期收益都低于债券基金、混合基金和股票基金。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人交通银行根据本基金合同规定,于 2007 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据取自巨田货币市场基金 2006 年第四季度报告,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	148,698,023.47	69.29%
买入返售证券	–	–
其中:买断式回购的买入返售证券	–	–
银行存款和清算备付金合计	64,973,177.09	30.27%
其他资产	939,115.03	0.44%
合计	214,610,315.59	100.00%

2、报告期债券回购融资情况

序号	项 目	金额(元)	占基金资产净值比(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1,349,270,000.00	4.61%
	其中:买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

报告期内本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况:

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
1	2006–11–09	20.30%	大额赎回造成被动超标	1个交易日

3、基金投资组合平均剩余期限情况

（1）投资组合平均剩余期限基本情况

项 目	天 数
报告期末投资组合平均剩余期限	120
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	174
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	109

报告期内不存在投资组合平均剩余期限违规超过 180 天的情况。

（2）期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	30.35%	–
2	30天(含)—60 天	–	–
3	60天(含)—90 天	18.64%	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	14.02%	
4	90天(含)—180 天	23.41%	–
5	180天(含)—397 天（含）	27.40%	–
合 计		99.80%	–

4、报告期末债券投资组合

（1）按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	–	–
2	金融债券	80,148,604.64	37.44%
	其中:政策性金融债	80,148,604.64	37.44%
3	央行票据	29,402,052.81	13.73%
4	企业债券	39,147,366.02	18.29%
5	其他	–	–
合 计		148,698,023.47	69.46%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		30,022,945.69	14.02%

（2）基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	05国开 02	500,000	–	50,125,658.95	23.41%
2	05农发 06	300,000	–	30,022,945.69	14.02%
3	06央票 66	300,000	–	29,402,052.81	13.73%
4	06三一 CP01	100,000	–	9,891,513.16	4.62%
5	06新希望 CP01	100,000	–	9,800,085.90	4.58%
6	06铁三局 CP01	100,000	–	9,731,446.30	4.55%
7	06东安 CP01	100,000	–	9,724,320.66	4.54%

5、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%（含）–0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.15%
报告期内偏离度的最低值	0.04%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.09%

6、投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明:本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前,本基金暂不投资于交易所短期债券。

（2）本报告期内存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况

序号	发生日期	持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本占当日基金资产净值的比例	原因	调整期
1	2006–11–7	23.1862%	巨额赎回造成被动超标	1个交易日
2	2006–11–9	20.3222%	大额赎回造成被动超标	1个交易日

（3）本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内,本基金严格按照基金合同和招募说明书的规定进行投资决策,所投资品种无超出基金合同规定范围的情形,没有需要特别说明和补充的内容。本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

（4）其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	应收利息	939,115.03
合 计		939,115.03

（5）本基金本报告期内未投资资产支持证券。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效以来至 2006 年 12 月 31 日,本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较表:

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	0.1678%	0.0014%	0.1712%	0.0000%	–0.0034%	0.0014%
过去三个月	0.4953%	0.0010%	0.5081%	0.0000%	–0.0128%	0.0010%
自基金合同生效起至今	0.7086%	0.0011%	0.7555%	0.0001%	–0.0469%	0.001%

重要说明:本基金采取的收益分配方式是采用 1.00 元固定单位净值交易方式,自基金合同生效之日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人,并以份额形式按月结转到基金份额持有人的基金账户,使基金账面单位净值始终保持 1.00 元。

十三、基金的费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费;
（2）基金托管人的托管费;
（3）基金合同生效后的信息披露费用;
（4）基金份额持有人大会费用;
（5）基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费;
（6）证券交易费用;
（7）按照国家有关规定和本基金合同规定可以列入的其他费用。

法律法规另有规定时从其规定。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.33%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 0.33% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的划款指令,于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.1%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。计算方法如下:

H=E × 0.1% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的划款指令,于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。

（3）上述与基金运作有关的基金费用的种类中（3）至（7）项费用根据有关法规、基金合同及相应协议的规定,按费用实际支出金额,列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产列支。国家另有规定的除外。

4、基金管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和托管费,经中国证监会核准后公告。此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

（二）与基金销售有关的费用

1、基金的销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金以及本基金的市场推广、销售、服务等活动。

本基金的销售服务费率按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计算。

计算公式如下:

H = E × 0.25% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的销售服务费
E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的划款指令,于次月的前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,再由基金管理人支付给销售机构。

2、基金认购费

本基金免收认购费

3、基金申购费

本基金免收申购费

4、基金赎回费

本基金免收赎回费

5、基金转换费

基金转换费用由基金份额持有人承担,基金转换费用按照如下确定:

转换费用 = 转出份额 × 转换申请日的转出基金份额净值 × 转换费率

本基金的转换费率详见基金管理人最新的转换公告。

基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率。上述费率如发生变更,基金管理人还应最迟于新的费率实施前 3 个工作日在至少一种指定的信息披露媒体公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

6、与基金销售有关的费率调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整与基金销售有关的费率,调整后的费率在最新的招募说明书中列示。上述费率如发生变更,基金管理人最迟应于新的费率实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于 2006 年 7 月 27 日刊登的《巨田货币市场基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

序号	修改部分	说明
1	重要提示	基金合同生效后第一次对招募说明书进行更新,对该部分进行重新表述。
2	三、基金管理人	更新监事会部分成员职位信息。
		鉴于 2007 年新年度开始,相关人员的从业经验均在原有基础上增加 1 年。
		基金经理变更,更新基金经理的相关资料。
		更新投资决策委员会的成员相关资料。
3	四、基金托管人	根据基金托管人提供的内容,更新了基金托管人的有关资料。
4	五、相关服务机构	更新上海直销中心地址信息。
		更新世纪证券联系人。 更新平安证券联系电话。 增加信泰证券为巨田货币市场基金代销机构。
		基金的会计师事务所发生变更,更新相关信息。
5	六、基金的募集	基于基金合同生效后第一次对招募说明书进行更新,对该部分进行重新表述。
6	七、基金合同的生效	
7	八、基金份额的申购与赎回	
8	九、基金转换	报告期内开通基金转换业务并调整基金转换费率,更新相关信息。
9	十、基金的投资的“基金投资组合报告”	增加最近一期投资组合报告的内容,即截至 2006 年 12 月 31 日的基金投资组合报告。
10	十一、基金的业绩	增加基金的业绩。
11	十五、基金的费用与税收	报告期内开通基金转换业务并调整基金转换费率,更新相关资料。
12	二十二、对基金份额持有人的服务	报告期内开通基金定期定额投资计划,重新表述相关内容。
13	二十三、其他应披露事项	根据最新情况对相关应披露事项进行了更新。

巨田基金管理有限公司
二〇〇七年四月二日

北京京能热电股份有限公司 2006 年度报告摘要

（上接 A24 版）

利润及利润分配表
2006年 1–12 月
编制单位: 北京京能热电股份有限公司　　单位:元 币种:人民币

项目	本期数	上年同期数
一、主营业务收入	1,526,457,152.02	1,541,940,695.96
减:主营业务成本	1,225,729,847.91	1,284,135,700.73
主营业务税金及附加	15,381,664.69	14,063,056.66
二、主营业务利润（亏损以“–”号填列）	285,345,639.42	243,741,938.57
加:其他业务利润（亏损以“–”号填列）	5,203,734.56	5,681,507.71
减: 营业费用		
管理费用	101,335,408.17	77,257,986.99
财务费用	1,105,945.95	5,362,646.86
三、营业利润（亏损以“–”号填列）	188,108,019.86	166,802,812.43
加:投资收益（损失以“–”号填列）	10,495,910.94	13,175,068.85
补贴收入	7,846,559.96	16,361,746.47
营业外收入	218,880.40	368,531.78
减:营业外支出	9,424,371.14	2,024,380.00
四、利润总额（亏损总额以“–”号填列）	197,245,000.02	194,683,779.53
减:所得税	60,974,594.17	60,974,594.17
减:少数股东损益(合并报表填列)		
加:未确认投资损失(合并报表填列)		
五、净利润（亏损以“–”号填列）	136,270,405.85	133,709,185.36
加:年初未分配利润	114,102,941.48	121,807,593.20
其他转入		
六、可供分配的利润	250,373,347.33	255,516,778.56
减:提取法定盈余公积	13,627,040.59	13,370,918.54
提取法定公益金		13,370,918.54
提取职工奖励及福利基金(合并报表填列)		
提取储备基金		
提取企业发展基金		
利润归还投资		
七、可供股东分配的利润	236,746,306.74	228,774,941.48
减:应付优先股股利		
提取任意盈余公积	36,793,009.58	
应付普通股股利	108,938,400.00	114,672,000.00
转作股本的普通股股利		
八、未分配利润(未弥补亏损以“–”号填列)	91,014,897.16	114,102,941.48
补充资料:		
1.出售、处置部门或被投资单位所得收益		
2.自然灾害发生的损失		
3.会计政策变更增加(或减少)利润总额		
4.会计估计变更增加(或减少)利润总额		
5.债务重组损失		
6.其他		

公司法定代表人:刘海峡　　主管会计工作负责人:刘嘉凯　　会计机构负责人:张咏

现金流量表
2006 年 1–12 月
编制单位: 北京京能热电股份有限公司　　单位:元 币种:人民币

项目	本期数
一、经营活动产生的现金流量:	
销售商品、提供劳务收到的现金	1,752,121,185.68
收到的税费返还	
收到的其他与经营活动有关的现金	2,487,568.87
经营活动现金流入小计	1,754,608,754.55
购买商品、接受劳务支付的现金	982,257,233.25
支付给职工以及为职工支付的现金	139,820,351.84
支付的各项税费	244,575,642.21
支付的其他与经营活动有关的现金	75,678,837.75
经营活动现金流出小计	1,442,332,065.05
经营活动产生的现金流量净额	312,276,689.50
二、投资活动产生的现金流量:	
收回投资所收到的现金	
其中:出售子公司收到的现金	
取得投资收益所收到的现金	10,495,910.94
处置固定资产、无形资产和其他长期资产而收回的现金	3,233,481.60
收到的其他与投资活动有关的现金	5,790,000.00
投资活动现金流入小计	19,519,392.54
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金	137,951,176.09
投资所支付的现金	
支付的其他与投资活动有关的现金	
投资活动现金流出小计	137,951,176.09
投资活动产生的现金流量净额	–118,431,783.55
三、筹资活动产生的现金流量:	
吸收投资所收到的现金	
其中:子公司吸收少数股东权益性投资收到的现金	
借款所收到的现金	60,000,000.00
收到的其他与筹资活动有关的现金	
筹资活动现金流入小计	60,000,000.00
偿还债务所支付的现金	131,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息所支付的现金	110,607,450.40
其中:支付少数股东的股利	
支付的其他与筹资活动有关的现金	
其中:子公司依法减资支付给少数股东的现金	
筹资活动现金流出小计	241,607,450.40
筹资活动产生的现金流量净额	–181,607,450.40
四、汇率变动对现金的影响	
五、现金及现金等价物净增加额	12,237,455.55
补充材料	
1、将净利润调节为经营活动现金流量:	
净利润	136,270,405.85
加:少数股东损益(亏损以“–”号填列)	
减:未确认的投资损失	
加:计提的资产减值准备	7,930,444.05
固定资产折旧	182,860,820.80
无形资产摊销	
长期待摊费用摊销	
待摊费用减少（减:增加）	239,511.20
预提费用增加（减:减少）	1,346,795.15
处理固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(减:收益)	3,277,656.94
固定资产报废损失	
财务费用	3,234,777.24
投资损失（减:收益）	–10,495,910.94
递延税款贷项（减:借项）	
存货的减少（减:增加）	–1,434,194.88
经营性应收项目的减少(减:增加)	–35,674,597.16
经营性应付项目的增加(减:减少)	24,720,981.25
其他(预计负债的增加)	
经营活动产生的现金流量净额	312,276,689.50
2. 不涉及现金收支的投资和筹资活动:	
债务转为资本	
一年内到期的可转换公司债券	
融资租入固定资产	
3、现金及现金等价物净增加情况:	
现金的期末余额	181,144,955.34
减:现金的期初余额	168,907,499.79
加:现金等价物的期末余额	
减:现金等价物的期初余额	
现金及现金等价物净增加额	12,237,455.55

公司法定代表人:刘海峡　　主管会计工作负责人:刘嘉凯　　会计机构负责人:张咏

9.3 如果与最近一期年度报告相比,会计政策、会计估计和核算方法发生变化,提供具体说明。

与最近一期年度报告相比,会计政策、会计估计和核算方法未发生变化

9.4 重大会计差错的内容、更正金额、原因及其影响。

本报告期无重大会计差错更正

9.5 报告期内,公司财务报表合并范围未发生重大变化。

9.6 新旧会计准则股东权益差异调节表

重要提示

本公司于 2007 年 1 月 1 日起开始执行财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则》（以下简称“新会计准则”）,目前本公司正在评价执行新会计准则对本公司财务状况、经营成果和现金流量所产生的影响,在对其进行慎重考虑或参照财政部对新会计准则的进一步讲解后,本公司在编制 2007 年度财务报告时可能对编制“新旧会计准则股东权益差异调节表”（以下简称“差异调节表”）时所采用相关会计政策或重要认定进行调整,从而可能导致差异调节表中列报的 2007 年 1 月 1 日股东权益（新会计准则）与 2007 年度财务报告中列报的相应数据之间存在差异。

股东权益调节表
单位:元 币种:人民币

项目	注释	项目名称	金额
	1	2006年 12 月 31 日股东权益（现行会计准则）	1,576,954,875.10
1		长期股权投资差额	
		其中:同一控制下企业合并形成的长期股权投资差额	
		其他采用权益法核算的长期股权投资贷方差额	
2		拟以公允价值模式计量的投资性房地产	
3		因预计资产弃置费用应补提的以前年度折旧等	
4		符合预计负债确认条件的辞退补偿	
5		股份支付	
6		符合预计负债确认条件的重组义务	
7		企业合并	
		其中:同一控制下企业合并商誉的账面价值	
		根据新准则计提的商誉减值准备	
8		以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以及可供出售金融资产	
9		以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	
10		金融工具分拆增加的收益	
11		衍生金融工具	
12	2	所得税	7,064,530.35
13		其他	
		2007年 1 月 1 日股东权益（新会计准则）	1,584,019,405.45

公司法定代表人:刘海峡　　主管会计工作负责人:刘嘉凯　　会计机构负责人:张咏

董事长:刘海峡
北京京能热电股份有限公司
2007年 3 月 29 日