

巨田货币市场基金 2007年第四季度报告

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

基金管理人的董事会及高级管理人员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，并对内容的准确性、准确性和完整性承担个别及连带责任。自2008年1月15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信息，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本基金，但不保证基金一定盈利。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期为2007年1月1日起至2007年12月31日止。本报告期中的财务资料未经审计。

一、基金产品概况

1.基金简称：巨田货币
2.基金代码：163203
3.基金运作方式：契约型开放式
4.投资期限：首次认购/申购日期：2006年3月17日
5.投资期限：首次赎回/赎回应答日期：2006年3月17日
6.投资目标：

在保证本金安全和保值增值的前提下，追求高于业绩比较基准的收益率。

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

研究和资产配置：主要包括对股票、债券、货币市场、投资品种、投资时机、择时的选择与操作，并根据市场环境变化，寻找价值低估的资产和无风险套利机会，实现预期收益率。

企业比较策略：根据企业经营的税后利润率（ $(1 - \text{利息税率}) \times 100\%$ ）进行定期存款利率调整；

本基金在不同行业之间进行定期存款利率调整，从而根据企业经营的税后利润率（ $(1 - \text{利息税率}) \times 100\%$ ）进行定期存款利率调整。

2.基金费率：

名称：巨田基金管理有限公司
注册地址：深圳市福田区福华路5020号证券大厦4层
办公地址：深圳市福田区福华路5020号证券大厦4层
名称：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

二、主要财务指标和收益表现

单位：人民币元

| (一) 主要财务指标(未经审计) | | 本报告期初至财务报告期 | | 2007年4季度 | |
|------------------|--------------|-------------|--|-------------------------------------------------|--|
| 1 | 本期利润 | | | 3,095,791.45 | |
| 2 | 期末净资产 | | | 394,841,016.96 | |
| 3 | 期末基金份额净值 | | | 1.0000 | |
| 4 | 加权平均基金份额本期利润 | | | 0.0126 | |
| 5 | 过去6个月 | | | 1.4223% 0.0125% 0.9344% 0.0002% 0.4879% 0.0123% | |

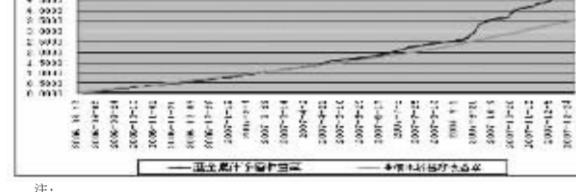
注：本基金收益分配是按月结转份额。
(二) 收益表现

1.与报告期平均净值增长率和业绩比较基准收益率比较

阶段 基金净值 收益率差 (%) 比较基准收益 (%) 比较基准收益差 (%) ①-(3) ②-(4)

过去6个月 1.4223% 0.0125% 0.9344% 0.0002% 0.4879% 0.0123%

2.本基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1.按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期。本报告期内，本基金的各项规

定的建仓比例和投资组合均符合有关规定。

3.报告期末基金总资产总额：2,432,366,206.26份

4.报告期末基金总负债总额：-200,701,103.21份

5.报告期末基金份额总额：3,094,841,016.96份

6.报告期末基金份额净值：1.0000元

7.报告期末可供分配基金份额总额：394,841,016.96份

8.报告期末已实现收益总额：316,640,290.06份

9.报告期末未分配收益总额：-0.0140份

10.报告期末持有的各类债券投资：3,010,397,431.06份

11.报告期末持有的各类资产支持证券：1,270.67份

12.报告期末持有的买入返售金融资产：-38,030,206.06份

13.报告期末持有的应收利息：316,640,290.06份

14.报告期末持有的其他资产：-0.0140份

15.报告期末持有的现金：3,010,397,431.06份

16.报告期末持有的现金及现金等价物：3,010,397,431.06份

17.报告期末持有的存出保证金：-0.0140份

18.报告期末持有的其他资产：-0.0140份

19.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

20.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

21.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

22.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

23.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

24.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

25.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

26.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

27.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

28.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

29.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

30.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

31.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

32.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

33.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

34.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

35.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

36.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

37.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

38.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

39.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

40.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

41.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

42.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

43.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

44.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

45.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

46.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

47.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

48.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

49.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

50.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

51.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

52.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

53.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

54.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

55.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

56.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

57.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

58.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

59.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

60.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

61.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

62.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

63.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

64.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

65.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

66.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

67.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

68.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

69.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

70.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

71.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

72.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

73.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

74.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

75.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

76.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

77.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

78.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

79.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

80.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

81.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

82.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

83.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

84.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

85.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

86.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

87.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

88.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

89.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

90.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

91.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

92.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

93.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

94.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

95.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

96.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

97.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

98.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

99.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

100.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

101.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

102.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

103.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

104.报告期末持有的其他负债：-0.0140份

105.报告期末持有的其他负债：-0.0140份