国泰金马稳健回报证券投资基金

更新招募说明书摘要

（2008年第二号）

基金管理人：国泰基金管理有限公司　基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

国泰金马稳健回报证券投资基金(以下简称“国泰金马稳健回报基金”或“本基金”)经中国证监会2004年4月27日发布的证监基金字[2004]62号文批准发起设立。本基金的基金合同于2004年6月18日成立正式生效。

国泰基金管理有限公司(“本基金管理人”或“基金管理人”或“管理人”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者拟申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本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。

本摘要根据本基金的基金合同和更新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《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、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，应详细查阅本基金的基金合同。

本基金的基金合同已经根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关规定作了修订并已于中国证监会指定报刊或网站进行了公告。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2008年12月18日，投资组合报告为2008年3季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2008年6月30日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称:国泰基金管理有限公司

设立日期:1998年3月5日

注册地址:上海市浦东新区峨山路91弄98号201A

办公地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

法定代表人:陈勇胜

注册资本:1.1亿元人民币

联系人:杨荣华

联系电话:（021）38561735

股本结构:

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	70%
万联证券有限责任公司	20%
中国电力财务有限公司	10%

（二）基金管理人管理基金的基本情况

截至2008年12月18日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金:基金金泰、基金金鑫、基金金盛，以及9只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由基金金鼎转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）。另外，本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金3个投资组合。

2007年11月19日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月18日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于4月1日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

（三）主要人员情况

1、董事会成员:

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，16年证券从业经历。1982年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992年起任国泰证券公司国际业务部总经理，总经理助理兼北京分公司总经理，1998年3月起任公司董事、总经理，1999年10月起任公司董事长。

陈良秋，董事，大学本科。1993年7月起在中国建设银行厦门市分行工作，历任业务科副经理、办公室副总经理、支行副行长、行长。2006年10月起在中国建银投资有限责任公司工作，任企业管理部总经理助理、副总经理，兼任中投科信科技股份有限公司董事。2007年11月起任公司董事。

刘晶，董事，博士研究生，高级经济师。1997年4月起在中国建设银行总行工作，任投资银行部（中间业务部）高级副经理。2005年1月起任中国建银投资有限责任公司投资银行部高级经理。2005年11月起任中投证券经纪业务部总经理、市场部总经理、资本市场部总经理。2007年7月起任中国建银投资有限责任公司投资银行部副总经理。2007年11月起任公司董事。

张和之，董事，硕士研究生、高级会计师。曾任水利电力部机关财务处主任科员，能源部机关财务处副处长，电力部机关事务局经营财务处处长，国电中兴实业发展总公司副总经理、总会计师，现任中国电力财务有限公司副董事长、党组副书记（正局级）、工会主席、纪检组长。2004年2月起任公司董事。

王耀南，董事，大专，15年证券从业经历。1993年至1996年任职广州珠江信托投资公司证券部。1996年–2001年任职广州珠江实业集团财务公司。2001年至今在万联证券有限责任公司，历任办公室主任、工会主席、行政总监、董事。2006年4月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，15年证券从业经历。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作，历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任党支部副书记、副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年5月担任公司总经理。2007年11月起任公司董事、总经理。

龚浩成，独立董事，硕士研究生，教授。长期从事金融证券研究和管理，1979起历任上海财经学院副教授、教授、副院长，中国人民银行上海分行副行长、行长，国家外汇管理局上海市分局副局长、局长，上海证券交易所常务理事（主持理事会工作），上海证券期货学院院长、教授。2001年5月起任公司独立董事。

曹尔阶，独立董事，大学本科，研究员。长期从事金融证券研究和管理，1979年起历任中国建设银行总行投资研究所副所长、中国建设银行总行投资调查部主任、中国投资咨询公司总经理、中国国际金融公司高级顾问。2001年5月起任公司独立董事。

吴鹏，独立董事，博士研究生。著名律师，执业范围包括金融证券。曾在日本著名律师事务所从事与中国相关法律工作，日本西南大学讲授中国法律。1993年回国从事律师工作，现为北京中伦金通律师事务所合伙人，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。2001年5月起任公司独立董事。

2、监事会成员:

万树斌，监事会主席，大学本科，高级会计师。1984年起在中国建设银行总行工作，历任会计部副处长、计财部副处长、处长、资债部高级经理。2005年1月起任中国建银投资有限责任公司财会部副总经理，兼任建投中信资产管理公司监事长。2007年11月起任公司监事会主席。

李芝樑，监事，硕士研究生。曾任中建一局集团第五建筑工程公司宣传部干事，中国电力财务有限公司债券基金部副经理、经理，投资银行部主任，现任中国电力财务有限公司发展研究中心主任。2004年2月起任公司监事。

黄晓晔，监事，博士研究生，经济师。7年证券从业经历。1996年7月起在广州五星化工厂任工程师。2000年4月起在广东省电信公司研究员。2001年6月起任南方证券高级经理。2004年5月起任银华基金管理有限公司高级经理。2005年10月起任万联证券研究发展中心总经理，万联证券副总裁。2007年11月起任公司监事。

王骏，监事，硕士研究生，曾任国泰君安证券公司会计、清算部经理，2001年10月加入国泰基金管理有限公司，从事基金登记核算工作，现任运营管理部副总监（主持工作）。2007年11月起任公司职工监事。

安萍，监事，硕士研究生。1999年7月起在上海司法审计事务所、澄打银行上海分行工作。2001年1月加入国泰基金管理有限公司，从事稽核监察部内审工作，曾任稽核监察部副总监。现任人力资源部总监。2008年9月起任公司职工监事。

3、高级管理人员

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

金旭，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

巴立康，副总经理，硕士研究生，15年证券从业经历。曾任华夏证券有限公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理，华夏基金管理有限公司基金运营总监、稽核总监。现任国泰基金管理有限公司副总经理。

丁昌海，督察长，硕士研究生，14年证券从业经历。曾任国泰证券公司证券发行部副经理，证券投资部经理和基金管理部经理，1998年起历任国泰基金管理有限公司研究开发部总监，稽核监察部总监，公司督察长。

4、本基金的基金经理及助理

（1）现任基金经理

余荣权，男，硕士研究生，15年证券基金从业经验。1993年7月至2000年6月在深圳赛格集团财务公司投资部任经理；2000年6月至2002年11月在上海华宝信托投资公司投资管理部任总经理；2002年11月至2007年7月在华宝兴业基金管理有限公司任投资总监；2003年7月至2004年5月兼任宝康灵活配置基金的基金经理；2006年4月至2007年4月兼任华宝兴业多策略增长基金的基金经理；2007年8月加盟国泰基金管理有限公司，任投资总监；2008年4月起任国泰金马稳健回报基金的基金经理。

程洲，男，硕士研究生，CFA，8年证券基金从业经验。2000年7月至2004年3月在上海申银万国证券研究所策略研究部任策略分析师；2004年4月加盟国泰基金管理有限公司，历任高级策略分析师、基金经理助理；2008年4月起任国泰金马稳健回报基金的基金经理。

（2）历任基金经理

2004年6月至2008年3月，由何江旭担任基金经理；2008年4月至今由余荣权、程洲担任基金经理。

5、投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员由公司总经理、投资总监、研究开发部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系负责人等人员组成，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。其主要职责是根据有关法规、基金合同，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究或相关投资部门提出重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下:

金旭、余荣权、初伟斌、何江旭、刘夫、梁之平。

丁昌海和巴立康列席投资决策委员会会议。上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:郭树清

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:尹东

联系电话:(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代号:HK0939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为:233，689，084，000股（包括224，689，084，000股H股及9，000，000，000股A股）。2008年，中国建设银行的综合盈利能力和资产质量继续同业领先，截止2008年6月30日，中国建设银行实现净利润586.92亿元，同比增长71.34%。年化平均资产回报率为1.72%，年化平均股东权益回报率为26.36%，分别较上年同期提高0.54个百分点和6.56个百分点，每股盈利为0.25元，同比增长0.10元。总资产达到70，577.06亿元，较上年末增长6.96%。资产质量稳步上升，不良贷款额和不良贷款率实现双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为2.21%，较上年末下降0.39个百分点。拨备水平充分，拨备覆盖率为117.23%，较上年末提升12.82个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约、悉尼设有代表处。2006年12月，中国建设银行在香港收购了美国银行在香港的全资子公司美国银行(亚洲)股份有限公司100%的股权，美国银行(亚洲)有限公司更名为“中国建设银行(亚洲)股份有限公司”。

2008年上半年，中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的世界银行500强中列第18位；被美国《福布斯》杂志评为全球上市公司2000强第69位；被英国《金融时报》评为“全球500强”第62位；在英国《金融时报》公布的全球市值500强中列第20位；在美国《财富》杂志全球企业500强排名中列第171位，较上年大幅提升59位；荣获英国《欧洲货币》杂志「最佳房地产投资奖」、香港《资本》杂志「中国杰出零售银行奖」、万事达国际组织「最佳商务卡奖」、「最佳联名卡奖」、「最佳产品设计奖」和香港《财资》杂志「中国最佳托管银行」等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工110余人。2008年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会（AICPA）颁布的审计准则公告第70号（SAS70）进行的内部控制审计，并被安永会计师事务所评价为“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

（二）主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

截止到2008年6月30日，中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、银丰等7只封闭式证券投资基金，以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华–道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长、信达澳银领先增长、诺德价值优势、工银瑞信增强收益、国泰金鼎价值、富国天博、融通领先成长、华宝兴业行业精选、工银瑞信红利、泰达荷银市值优选、长城品牌优选、交银施罗德蓝筹、华夏全球精选、易方达增强回报、南方盛元红利、交银施罗德增利、工银瑞信信用添利、宝盈资源优选、华安稳定收益、兴业社会责任、华宝兴业海外中国成长、宝盈增强收益、鹏华丰收债券、博时特许价值、华富收益增强、信诚盛世蓝筹、东方策略成长、海富通全球精选中国概念等71只开放式证券投资基金。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司上海理财中心	地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		电话:021–38561727	传真:021–68775881
		客户服务专线:400–888–8688,021–38569000	
		联系人:靖研	网址:www.gtfund.com
2	国泰基金管理有限公司北京理财中心	地址:中国北京市西城区金融大街7号第6层,627–628单元	
		电话:010–66553055	传真:010–66553082
		联系人:魏文	
3	国泰基金电子交易平台	网站:www.gtfund.com登录网上交易页面	
		电话:021–38561737	联系人:严仁明

2、代销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	中国建设银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街25号	
		办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	
		法定代表人:郭树清	客服电话:95533
		网址:www.ccb.com	
2	中国工商银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号(100005)	
		办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号(100005)	
		法定代表人:姜建清	电话:95588
		网址:www.icbc.com.cn	
3	中国农业银行	注册地址:北京市东城区建国门内大街69号	
		法定代表人:项俊波	客户服务电话:95599
		联系人:蒋浩	传真:010–85109219
		网址:www.95599.cn	
4	中国银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号	
		法定代表人:肖钢	联系人:客户服务中心
		客服电话:95566	网址:www.boc.cn
5	交通银行股份有限公司	注册地址:上海市银城中路188号	
		法定代表人:胡怀邦	客服电话:95559
		联系人:曹榕	电话:021–58781234
		网址:www.bankcomm.com	
6	招商银行股份有限公司	注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
		法定代表人:秦晓	联系人:兰奇
		电话:0755–83198888	传真:0755–83195109
		客户服务热线:95555	网址:www.cmbchina.com
7	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号	
		办公地址:上海市中山东一路12号	
		法定代表人:吉晓辉	电话:021–61618888
		联系人:汤嘉惠、虞容云	客户服务热线:95528
		网址:www.spdb.com.cn	
8	华夏银行股份有限公司	注册地址:北京市东城区建国门内大街22号	
		办公地址:北京市东城区建国门内大街22号	
		法定代表人:翟鸿祥	客户服务热线:95577
		网址:www.hxb.com.cn	
9	中信银行股份有限公司	注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座	
		法定代表人:孔丹	联系人:李博
		电话:010–65557060	传真:010–65550827
		客服电话:95558	网址:bank.ecitic.com
10	中国民生银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号	
		法定代表人:董文标	联系人:李群
		电话:010–58351666	传真:010–83914283
		客服电话:95568	网址:www.cmbc.com.cn
11	北京银行股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街17号	
		法定代表人:阎冰竹	联系人:李娟
		电话:010–66226044	传真:010–66223314
		客服电话:010–96169(北京)022–96269(天津) 021–53599688(上海)	
		网址:www.bankofbeijing.com.cn	
12	中国邮政储蓄银行有限责任公司	注册地址:北京市西城区宣武门西大街131号	
		法定代表人:刘安东	联系人:陈春林
		客服电话:11185	网址:www.psbc.com
13	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址:浦东新区浦东大道981号	
		法定代表人:李秀仓	客服电话:021–962999
		网址:www.shrcb.com	
14	中国建银投资证券有限责任公司	注册地址:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48–50层	
		法定代表人:杨小阳	联系人:刘权
		电话:0755–82026521	客服电话:400–600–8008
		网址:www.cjis.cn	
15	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	
		法定代表人:祝幼一	联系人:芮敏祺
		电话:021–38676161	传真:021–38670161
		客服电话:400–888–8666	网址:www.gtja.com
16	宏源证券股份有限公司	注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号宏源大厦	
		法定代表人:汤世生	联系人:张智红
		电话:010–62294608–6290	传真:010–62294601
		网址:www.ehongyuan.com	
17	万联证券有限责任公司	注册地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层	
		法定代表人:李舫金	联系人:刘广
		电话:020–37865031	传真:020–37865030
		客服电话:400–888–8133	网址:www.wlzq.com.cn
18	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	
		法定代表人:张佑君	联系人:魏明
		电话:010–85130588	传真:010–65182261
		客服电话:400–888–8108	网址:www.csc108.com
19	海通证券股份有限公司	注册地址:上海市淮海中路98号	
		法定代表人:王开国	联系人:金芸、杨薇
		电话:021–23219000	传真:021–23219100
		客服电话:400–888–8001(全国),021–95553	
		网址:www.htsec.com	
20	中国银河证券股份有限公司	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:肖时庆	联系人:李洋
		电话:010–66568047	传真:010–66568536
		网址:www.chinastock.com.cn	
21	中信金通证券有限责任公司	注册地址:杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座	
		法定代表人:刘军	联系人:王勤
		电话:0571–85783715	客服电话:0571–96598
		网址:www.bigsun.com.cn	
22	申银万国证券股份有限公司	注册地址:上海市常熟路171号	
		法定代表人:丁国荣	联系人:邓寒冰
		电话:021–54033888	传真:021–54038844
		客服电话:021–962505	网址:www.sw2000.com.cn
23	东方证券股份有限公司	注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层–29层	
		法定代表人:王益民	联系人:吴宇
		电话:021–63325888	传真:021–63326173
		客服电话:021–962506	网址:www.dfzq.com.cn
24	东吴证券有限责任公司	注册地址:苏州市石路爱河桥路28号	
		法定代表人:吴永敏	联系人:方晓丹
		电话:0512–65581136	传真:0512–65588021
		客服电话:0512–96288	网址:www.dwzq.com.cn
25	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、41和42楼	
		法定代表人:王志伟	联系人:肖中梅
		电话:020–87555888	传真:020–87555305
26	国盛证券有限责任公司	注册地址:江西省南昌市永叔路15号	
		办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10–13楼	
		法定代表人:曾荣升	联系人:徐美云
		电话:0791–6285337	传真:0791–6289395
		网址:www.gsstock.com	
27	民生证券有限责任公司	注册地址:北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室	
		法定代表人:岳献春	联系人:赵明
		电话:010–85252656	传真:010–85252655
		客服电话:0371–67639999	网址:www.mszq.com
28	上海证券有限责任公司	注册地址:上海市九江路111号	
		法定代表人:蒋元真	联系人:黄枫
		电话:021–62470157	传真:021–62470244
		客服电话:021–962518	
29	光大证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔15–16楼	
		法定代表人:徐浩明	联系人:刘晨
		电话:021–68816000	传真:021–68815009
		客服电话:10108998,400–888–8788 网址:www.ebscn.com 网址:www.ebscn.com	
30	中信万通证券有限责任公司	注册地址:青岛市崂山区香港东路316号	
		办公地址:青岛市东海西路28号	
		法定代表人:史洁民	联系人:丁韶燕
		电话:0532–85022026	传真:0532–85022026
		客服电话:0532–96577	网址:www.zxwt.com.cn
31	中信证券股份有限公司	注册地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦	
		法定代表人:王东明	联系人:陈忠
		电话:010–84588888	传真:010–84865560
		网址:www.ecitic.com	
32	华泰证券股份有限公司	办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦	
		法定代表人:吴万善	联系人:张小波
		电话:025–84457777	网址:www.htzq.com.cn
		客服电话:025–84579897	
33	长江证券股份有限公司	注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦	
		法定代表人:胡运钊	联系人:李良
		电话:021–63219781	传真:021–51062920
		客服电话:400–888–8999	网址:www.cjsc.com
34	国海证券有限责任公司	注册地址:广西南宁市滨湖路46号	
		法定代表人:张雅锋	联系人:覃清芳
		电话:0771–5539262	传真:0771–5539033
		客服电话:400–888–8100(全国),96100(广西)	
		网址:www.ghzq.com.cn	
35	渤海证券股份有限公司	注册地址:天津市经济技术开发区第一大街29号	
		办公地址:天津市河西区宾水道3号	
		法定代表人:张志军	联系人:王兆权
		电话:022–28451861	传真:022–28451892
		客服电话:4006515988	网址:www.ewww.com.cn
36	联合证券有限责任公司	注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、25层	
		法定代表人:马昭明	联系人:盛宗凌
		电话:0755–82492000	传真:0755–82492962
		客服电话:400–888–8555,0755–25125666	
		网址:www.lhzq.com	
37	中原证券股份有限公司	注册地址:许昌市南关大街38号	
		办公地址:郑州市经三路15号广汇国贸11楼	
		法定代表人:张建刚	联系人:陈利民
		电话:0371–65585670	传真:0371–65585670
		咨询电话:0371–967218	网址:www.ccnew.com
38	国信证券股份有限公司	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
		客服电话:800–810–8868	网址:www.guosen.com.cn
39	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38–45层	
		法定代表人:宫少林	联系人:黄健
		电话:0755–82943666	传真:0755–82943636
		址:www.newone.com.cn	客服电话:400–8888111\95565
40	兴业证券股份有限公司	注册地址:福建省福州市湖东路99号标力大厦	
		法定代表人:兰荣	联系人:杨盛芳
		电话:021–68419974	传真:021–68419867
		网址:www.xyzq.com.cn	
41	齐鲁证券有限公司	注册地址:山东省济南市经十路128号	
		办公地址:山东省济南市经十路128号	
		法定代表人:李玮	联系人:傅咏梅
		电话:0531–81283728	传真:0531–81283735
		客服电话:96538	网址:www.qlzq.com.cn
42	安信证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元	
		法定代表人:牛冠兴	联系人:张勤
		联系电话:021–68801217	传真:021–68801119
		网址:www.essences.com.cn	
43	东莞证券有限责任公司	注册地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼	
		法定代表人:蔚鹏辉	联系人:罗绍辉
		电话:961130	传真:0769–22119423
		网址:www.dgzq.com.cn	
44	恒泰证券有限责任公司	注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号	
		法定代表人:刘汝军	联系人:常向东
		电话:0471–4913998	传真:0471–4930707
		客服电话:0471–4961259	网址:www.cnht.com.cn

（二）注册登记机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区峨山路91弄98号201A	
		办公地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		法定代表人:陈勇胜	传真:021–38561800
		联系人:杨荣华、陆未定	
		客户服务专线:400–888–8688,021–38569000	

（三）律师事务所和经办律师

序号	机构名称	机构信息	
1	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SOHO A座31层	
		负责人:王玲	联系人:王建平、王恩顺
		电话:010–58785588	传真:010–58785599
		经办律师:王建平、王恩顺	

（四）会计师事务所和经办注册会计师

序号	机构名称	机构信息	
1	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:陈宇
		电话:021–61238888	传真:021–61238800
		经办注册会计师:薛克、陈宇	

四、基金名称

国泰金马稳健回报证券投资基金

五、基金类型

契约型开放式基金

六、投资目标

通过股票、债券资产和现金类资产的合理配置，高度适应中国宏观经济的发展变化。紧盯不同时期对中国GDP增长具有重大贡献或因GDP的高速增长而获得较大受益的行业和上市公司，最大程度地分享中国宏观经济的成长成果，为基金份额持有人谋求稳健增长的长期回报。

七、投资范围

限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金组合投资的基本范围:股票资产40%–95%；债券资产55%–0；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%。如果法律法规对投资比例限制有最新规定的，本基金从其规定。

八、投资策略

本基金采取定性与定量分析相结合的方式，通过资产配置有效规避资本市场的系统性风险；通过对不同时期与GDP增长密切相关的投资、消费、进出口等因素的深层研究，准确预期并把握对GDP增长贡献度大及受GDP增长拉动受益度大的重点行业及上市公司；通过个股选择，挖掘具有成长潜力且被当前市场低估的重点上市公司。在债券投资方面，主要基于长期利率趋势以及中短期经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资管理。

九、业绩比较基准

业绩基准=60%×〖上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均〗+40%×〖上证国债指数〗（在其它较理想的业绩基准出现以后，经一定程序会对现有业绩基准进行替换）

十、风险收益特征

本基金属于中低风险的平衡型基金产品，基金的预期收益高于债券型基金，风险程度低于激进的股票型基金。

十一、基金投资组合报告

本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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定，于2008年10月21日复核了投资组合报告内容，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截止2008年9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

分类	市值(元)	占总资产比例
股票	4,200,251,756.73	85.71%
债券	107,358,892.27	2.19%
权证	2,583,217.42	0.05%
银行存款和结算备付金	519,878,907.82	10.61%
其他资产	70,642,900.45	1.44%
合计	4,900,715,674.69	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	分类	市值(元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	50,905,339.44	1.05%
2	采掘业	511,506,763.61	10.57%
3	制造业	1,435,348,394.61	29.67%
	其中:食品、饮料	42,299,843.95	0.87%
	木材、家具	1,217,534.22	0.03%
	造纸、印刷	32,766,022.75	0.68%
	石油、化学、塑胶、塑料	119,343,247.28	2.47%
	电子	6,796,305.67	0.14%
	金属、非金属	804,887,867.18	16.64%
	机械、设备、仪表	332,556,522.73	6.87%
	医药、生物制品	95,481,050.83	1.97%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	165,326,581.18	3.42%
5	建筑业	56,020,485.02	1.16%
6	交通运输、仓储业	43,140,000.00	0.89%
7	信息技术业	346,465,967.60	7.16%
8	批发和零售贸易	316,867,841.90	6.55%
9	金融、保险业	765,837,364.60	15.83%
10	房地产业	363,051,874.82	7.50%
11	社会服务业	72,529,814.35	1.50%
12	传播与文化产业	0.00	0.00%
13	综合类	73,251,329.60	1.51%
	合计	4,200,251,756.73	86.82%

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例的前十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数