

国泰金马稳健回报证券投资基金更新招募说明书摘要

(2006 年第一号)

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。本基金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,投资者申购基金时应认真阅读更新后的招募说明书。

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 2006 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:上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31 楼
办公地址:上海市黄浦区延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼
法定代表人:陈勇胜
注册资本:1.1 亿元人民币
股本结构上海国有资产经营有限公司(持股比例 24%)、国泰君安证券股份有限公司(持股比例 24%)、万联证券有限责任公司(持股比例 20%)、上海爱建信托投资股份有限公司(持股比例 20%)、中国电力财务有限公司(持股比例 10%)、上海仪电控股股份有限公司(持股比例 2%)

信息披露负责人:丁昌海
联系电话:(021)23060282
(二)主要人员情况
1、董事会:
陈勇胜,董事长,硕士,14 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,公司总经理助理兼北京分公司总经理,1998 年 3 月起任国泰基金管理公司总经理,1999 年 10 月起任董事长。

李春平,董事,总经理,硕士、EMBA,13 年证券从业经历。1993 年起历任国泰证券公司行政管理部经理、证券管理部总经理,1999 年起任国泰君安证券股份有限公司总裁助理,1999 年 10 月起任国泰基金管理公司总经理。

袁平,董事,硕士。1989 年起先后在中国银行上海分行、上海国联财务有限公司、万宝集团、上海波尔强国际贸易有限公司、富源国际贸易上海有限公司、上海国有资产经营有限公司工作,2002 年 1 月起至今担任上海国有资产经营有限公司资产经营部总经理。

何伟,董事,硕士,13 年证券从业经历。1993 年至 1999 年担任君安证券股份有限公司总裁助理、总裁办主任、资产管理部常务副总经理,北京总部总经理、北京、上海、黑龙江营业部总经理、投资二部经理等职。1999 年起担任国泰君安证券股份有限公司总裁助理、兼企业融资部总经理、收购兼并部总经理、深圳分公司总经理等职。现任国泰君安证券股份有限公司副总裁。

周志平,董事,本科。曾任铁道兵十一师技术员,武警江西总队后勤部助理员、处长,北京武警总队后勤部处长,科瑞集团投行部总经理,现任浙江省国际信托投资公司有限责任公司基金业务部负责人。

张和之,董事,硕士。曾任北京半导体器件二厂财务科会计主管、审计科干部,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总会计师,现任中国电力财务有限公司副总经理。

张明芝,董事,本科。1994 年起在上海商业网点股份公司从事投资计划和资产管理等工作,1998 年历任上海爱建信托投资公司投资基金部副经理、资产信托部总经理。

龚浩成,独立董事,硕士。长期从事金融证券研究和管理工作,1979 起历任上海财经学院副教授、教授、副院长,1984 年起历任人行上海分行副行长、行长,上海外管局副局长、局长,1992 年起任上交所常务理事,1995 年起任上海证券期货学院院长。

曹尔阶,独立董事,本科。长期从事金融证券研究和管理,中国国际金融有限公司高级顾问,中国财科所教授,清华大学、中央财大、中国金融学院兼职教授,曾任中国投资咨询公司总经理。

吴鹏,独立董事,博士。著名律师,执业范围包括金融证券,北京中伦律师事务所合伙人、主任,北京大学客座教授,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。

董辅奶,独立董事,博士(因病去世,待补选)。
2、监事会:
黄明达,监事,博士。曾任华东师范大学城市与区域发展研究中心讲师,深圳龙翔实业股份有限公司研究发展部副总经理,上海国有资产经营有限公司资金管理部部长,现任上海国有资产经营有限公司资金管理部部长。
李芝桦,监事,硕士。曾任中建一局集团第五建筑工程公司宣传干事,中国电力财务有限公司债券基金部副经理,现任中国电力财务有限公司债券基金部副经理。
黄永明,监事,硕士,11 年证券从业经历。1995 年起任国泰证券公司行政管理部副经理,1998 年起历任国泰基金管理有限公司综合部、监察部、战略管理部副总监。

3、其他高级管理人员:
陈坚,副总经理,MBA,证券从业年限 12 年。1994 年起历任国泰证券公司研发部副总经理、总经理,1998 年起任国泰基金管理有限公司副总经理。
陈彪,副总经理,金融学博士后,8 年证券从业经历。曾在中国人保信托投资公司投资研究中心任研究员、中国人寿保险公司资金运用中心组合管理处副处长。2003 年 3 月起在国泰基金管理有限公司任职,历任投资总监、副总经理职务。

丁昌海,督察长,硕士,12 年证券从业经历。1994 年起历任国泰证券公司证券发行部项目经理、副经理,证券投资二部和基金管理部经理,1998 年起历任国泰基金管理有限公司监事,研究开发部总监,稽核监察部总监,信息披露负责人,现任公司督察长、风险控制委员会主任。

4、基金经理
何江旭,男,经济学硕士,13 年证券期货从业经历。曾就职于浙江信达期货经纪有限公司、君安证券公司、国信证券公司。2000 年加盟国泰基金管理公司,历任研究开发部总监助理、投资决策委员会秘书,金鼎基金基金经理,金鼎基金基金经理,现任基金管理部副总监,国泰金马稳健回报基金的基金经理。

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:壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍亿元人民币
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 5104

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史。其前身中国人民建设银行于 1954 年成立,于 1996 年易名为中国建设银行,是中国的四大国有商业银行之一。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。截至 2005 年 12 月 31 日止,中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)总资产达人民币 45,857.42 亿元,客户存款达人民币 40,060.46 亿元,2005 年实现税前利润人民币 553.64 亿元。截至 2005 年 12 月 31 日止,中国建设银行在中国内地设有 13,977 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、纽约设有代表处。英国《银行家》杂志 2005 年 7 月公布的世界 1,000 家大银行按一级资本排名中,中国建设银行列第 25 位,并被评选为中国“年度最佳银行”;荣获《财资》杂志 2005 年“中国最佳国内银行奖”;《全球托管人》杂志主办的“2005 年新兴市场托管服务调查”中,获得“中国最佳托管银行”称号。

中国建设银行总行设基金托管部,基金托管部下设综合管理处、基金市场处、资产托管处、OFII 托管处、基金核算处、基金清算处和监督稽核处 7 个职能处室,现有员工 70 余人。

(二)主要人员情况
罗中涛,基金托管部总经理,曾就职于国家统计局、建设银行总行评估、信贷、委托理财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,基金托管部副总经理,曾就职于建设银行总行人力资源部、计划

部、筹资部、国际业务部并担任领导工作,对计划、个人银行及国际业务具有丰富的经验。

(三)基金托管业务经营情况
截止到 2006 年 6 月 30 日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、金鼎、汉博、通宝、通乾、鸿飞、银丰共 11 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、华安上证 180ETF、长城消费增值股票、上投摩根双息平衡混合、湘财荷银效率优选混合、交银施罗德稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华夏深圳中小企业板 ETF、华富货币市场等共 33 只开放式证券投资基金,托管基金财产规模达 881.77 亿份。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
1、直销机构
(1)国泰基金管理有限公司上海理财中心
法定代表人:陈勇胜
办公地址:上海市黄浦区延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼
传真:(021)23060266
客户服务专线:4008-888-688,(021)33134688 联系人:孙艳丽、陆未

网站:www.gtfund.com
(2)国泰基金管理有限公司北京理财中心
注册地址:北京市海淀区中关村南大街 1 号友联宾馆贵宾楼一层
法定代表人:陈勇胜
联系电话:(010)68498552、(010)68498575
传真:(010)68498182
联系人:隋素梅
(3)国泰基金管理有限公司电子交易平台
国泰电子交易网站:www.gtfund.com
国泰电子交易热线:021-23060367
联系人:严明辉
2、代销机构
(1)中国建设银行
注册地址:北京市西城区金融大街 25 号
法定代表人:郭树清
客服电话:95533
(2)上海浦东发展银行
注册地址:上海市浦东新区浦东南路 500 号
法定代表人:金运
电话:(021)61618888
联系人:杨静
客服电话:(021)68881829
(3)交通银行
注册地址:上海市仙霞路 18 号
办公地址:上海市银城中路 188 号
法定代表人:蒋超良
电话:021-58781234
联系人:王珏
客服电话:95559
(4)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
电话:021-62580818-213
传真:021-62569400
服务热线:4008888666
联系人:芮静祺
电话:400-8888-108(免长途费)
传真:(010)65182261
联系人:权辉
网址:www.csc108.com
(6)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
联系电话:(021)62580818
传真:(021)63858549
联系人:金芸
(7)金通证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市凤起路 108 号 8-12 层
法定代表人:应立敏
联系电话:(0571)85783707
传真:(0571)85106383
联系人:何燕华
(8)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:谢平
联系电话:(021)154033888
传真:(021)64738844
联系人:胡洁静
(9)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
联系电话:(0755)82943234
传真:(0755)82943237
联系人:王玉亭
(10)东方证券股份有限公司
注册地址:上海浦东大道 720 号
法定代表人:王益民
联系电话:021-62568800*3019
传真:021-62568800*3019
联系人:盛云
(11)东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州市十梓街 298 号
法定代表人:吴永敏
联系电话:0512-65158588
客服热线:0512-65196288
传真:0512-65158028
联系人:汪健
(12)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
联系电话:(010)66568613,66568587
联系人:赵荣春、郭京华
(13)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市东山区东风东路 836 号东峻广场 34-35 层
法定代表人:陆景雄
联系电话:021-64151953
(14)民生证券有限责任公司
注册地址:北京市复兴门内大街 158 号远洋大厦 F13 层 1307 房
法定代表人:岳献春
联系电话:0371-7639999
(15)光大证券股份有限公司
注册地址:上海浦东南路 528 号证券大厦南塔 15-16 楼
办公地址:上海浦东南路 528 号证券大厦南塔 14-16 楼
法定代表人:王明权
电话:(021)68823685
传真:(021)68815009
联系人:刘晨
(16)广发证券股份有限公司
注册地址:广东省珠海市广东大道光大国际贸易中心 26 楼 2611 室
办公地址:广东广州天河区北路大都会广场 36,36,41 和 42 楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87556888
传真:(020)87557985
联系人:肖梅梅
(17)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 16-26 层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层
法定代表人:何如
联系电话:(0755)82130833
传真:0755-82133032
联系人:林建明
(18)宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市建设路 2 号
办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层
联系人:张智红
电话:010-62267799-6416
传真:010-62294470
联系人:张智红
(19)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:青岛市市南区东海西路 28 号
法定代表人:史洁民
电话:06532-85022026
传真:06532-85022026
联系人:丁邵燕
(20)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区湖贝路 1030 号海龙王大厦
办公地址:北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦三层
法定代表人:王东明
电话:010-84582666
传真:010-84965260
联系人:陈忠
(21)华泰证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
办公地址:南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025-84457777-721
传真:025-84579879
联系人:袁红彬

(二)注册登记机构
注册登记人:国泰基金管理有限公司
办公地址:上海市黄浦区延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 31 楼
法定代表人:陈勇胜
传真:(021)23060266
联系人:孙艳丽、陆未定
客户服务专线:4008-888-688 (021)33134688
(1)律师事务所和经办律师
律师事务所: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:王琦
电话:(010) 5878 5588
传真:(010) 5878 5599
联系人:王建平、王恩顺
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
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区东昌路 568 号(邮编:200120)
办公地址:上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼(邮编:200021)
法人代表:杨绍信
电话:(021)61238888
传真:(021)61238800
联系人:陈兆欣
经办注册会计师:汪稼、薛竟

四、基金名称
国泰金马稳健回报证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式基金
六、基金的投资目标
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,为基金持有人谋求稳健增长的长期回报。

七、基金的投资方向
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、法规和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 5%-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
本基金采取定性分析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对中短期经济周期、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型的平衡型基金产品,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 2006 年 7 月 19 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 2006 年 6 月 30 日,本报告所列财务数据未经审计。

分 类	市 值(元)	占总资产比例
股票	344,800,23897	89.28%
债券	19,958,050,000	5.17%
权证	1,004,388,000	0.26%
银行存款和清算备付金	17,059,295,64	4.42%
应收证券清算款	2,677,921,17	0.69%
其他资产	695,862,01	0.18%
合 计	386,195,755,79	100.00%

序号	分 类	市 值(元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采掘业	15,796,000.00	4.26%
3	制造业	171,834,191.59	46.29%
	其中:食品、饮料	63,232,360.66	17.03%
	纺织、服装、皮毛	6,876,117.70	1.85%
	造纸、印刷	6,780,000.00	1.83%
	石油、化学、塑胶、塑料	9,157,800.00	2.47%
	电子	15,969,500.00	4.30%
	金属、非金属	9,262,000.00	2.49%
	机械、设备、仪表	25,857,613.00	6.97%
	医药、生物制品	34,698,800.23	9.35%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	1,063,378.40	0.28%
5	建筑业	-	-
6	交通运输、仓储业	12,972,609.39	3.49%
7	信息技术业	23,120,000.00	6.23%
8	批发和零售贸易	44,412,177.77	11.96%
9	金融、保险业	14,902,366.33	4.01%
10	房地产业	16,171,623.23	4.36%
11	社会服务业	25,787,817.26	6.95%
12	传播与文化业	11,924,575.00	3.21%
13	综合类	6,825,500.00	1.84%
合 计	344,800,23897	92.88%	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市 值(元)	占净值比例
1	000895	双汇发展	1,451,889	46,255,380.13	12.19%
2	600628	G 新世界	3,065,663	26,947,177.77	7.26%
3	600594	G 益 佰	2,008,231	24,761,488.23	6.67%
4	000978	G 桂 旅	2,328,322	21,257,579.86	5.73%
5	600036	G 招 行	1,599,923	12,335,406.33	3.32%
6	600533	G 精 瑞	1,000,000	11,160,000.00	3.01%
7	600330	G 天 通	1,750,000	10,062,500.00	2.71%
8	600202	哈 空调	800,000	9,736,000.00	2.62%
9	600320	G 振 华	449,950	8,882,013.00	2.39%
10	600764	G 中广通	1,300,000	8,814,000.00	2.37%

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市 值(元)	占净值比例
1	000895	双汇发展	1,451,889	46,255,380.13	12.19%
2	600628	G 新世界	3,065,663	26,947,177.77	7.26%
3	600594	G 益 佰	2,008,231	24,761,488.23	6.67%
4	000978	G 桂 旅	2,328,322	21,257,579.86	5.73%
5	600036	G 招 行	1,599,923	12,335,406.33	3.32%
6	600533	G 精 瑞	1,000,000	11,160,000.00	3.01%
7	600330	G 天 通	1,750,000	10,062,500.00	2.71%
8	600202	哈 空调	800,000	9,736,000.00	2.62%
9	600320	G 振 华	449,950	8,882,013.00	2.39%
10	600764	G 中广通	1,300,000	8,814,000.00	2.37%

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市 值(元)	占净值比例
1	000895	双汇发展	1,451,889	46,255,380.13	12.19%
2	600628	G 新世界	3,065,663	26,947,177.77	7.26%
3	600594	G 益 佰	2,008,231	24,761,488.23	6.67%
4	000978	G 桂 旅	2,328,322	21,257,579.86	5.73%
5	600036	G 招 行	1,599,923	12,335,406.33	3.32%
6	600533	G 精 瑞	1,000,000	11,160,000.00	3.01%
7	600330	G 天 通	1,750,000	10,062,500.00	2.71%
8	600202	哈 空调	800,000	9,736,000.00	2.62%
9	600320	G 振 华	449,950	8,882,013.00	2.39%
10	600764	G 中广通	1,300,000	8,814,000.00	2.37%

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市 值(元)	占净值比例
1	000895	双汇发展	1,451,889	46,255,380.13	12.19%
2	600628	G 新世界	3,065,663	26,947,177.77	7.26%
3	600594	G 益 佰	2,008,231	24,761,488.23	6.67%
4	000978	G 桂 旅	2,328,322	21,257,579.86	5.73%
5	600036	G 招 行	1,599,923	12,335,406.33	3.32%
6	600533	G 精 瑞	1,000,000	11,160,000.00	3.01%
7	600330	G 天 通	1,750,000	10,062,500.00	2.71%
8	600202	哈 空调	800,000	9,736,000.00	2.62%
9	600320	G 振 华	449,950	8,882,013.00	2.39%
10	600764	G 中广通	1,300,000	8,814,000.00	2.37%

注:截止报告期末,双汇发展因股权分置改革因素停牌,本基金因基金资产净值波动等因素,持有双汇发展市值占基金资产净值比例超过 10%的规定,属于被动超标比例,本基金将在双汇发展复牌后根据法律法规和基金合同的规定及时调整达标。

序号	债券品种	市 值(元)	占净值比例
1	金融债券	19,958,050.00	5.38%
	合 计	19,958,050.00	5.38%

序号	债券名称	市 值(元)	占净值比例
1	06 农发 02	19,958,050.00	5.38%

6、报告附注
(1)报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。
(2)基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。
(3)其他资产的构成如下:

分 类	市 值(元)
交易保证金	477,063.27
应收利息	96,442.74
应收申购款	122,356.00
合 计	695,862.01

(4)报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。
(5)本报告期内投资权证明细如下:
a、股权分置改革被动持有

权证代码	权证名称	配售日期	配售数量(股)	成本(元)
580990	茅台 JCP1	2006/5/25	384,000	0.00
合计			384,000	0.00

b、本报告期内无主动投资的权证。
(6)本报告期内未投资资产支持证券。

十二、基金的投资