

国泰金龙系列证券投资基金

更新招募说明书摘要

2006年第二号

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

重要提示

国泰金龙系列证券投资基金(以下简称“金龙系列基金”或“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会证监基金字【2000】114号文批准公开发行。本系列基金的基金合同于2003年12月5日正式生效。

国泰基金管理有限公司(“本系列基金管理人”或“基金管理人”或“管理人”)保证本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,但中国证监会对本系列基金募集的核准,并不表明其对本系列基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本系列基金没有风险。

本系列基金由国泰金龙债券证券投资基金、国泰金龙行业精选证券投资基金和将来经批准纳入本系列基金管理的其它基金组成。本系列基金使用同一个招募说明书和基金合同,由同一基金管理人管理,同一基金托管人托管,不同的基金具有不同的投资政策,独立核算,分帐管理,分别进行注册登记。投资者根据持有不同基金的基金份额享受收益和承担风险。请投资者注意本系列基金产品特点。

投资有风险,投资人在申购基金前应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本系列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,应详细阅读本基金的基金合同。

本系列基金的基金合同已经根据《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和网站进行了公告。

本更新招募说明书已经本系列基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为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: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:上海市黄浦区延安东路700号港泰广场22-23楼
法定代表人:陈勇
注册资本:11亿元人民币
股权结构: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%)、中国人寿资产管理有限公司(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:丁卫海
联系电话:(021)23060282
(二)主要人员情况
1.董事会:
陈勇,董事长,硕士,16年证券从业经历。1982年起在中国建设银行总行、中国农业银行总行工作。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有限公司总经理,1999年10月起任董事长。
李勇,董事,硕士,曾任上海证券业协理,1993年起历任国泰证券公司行政管理部总经理、证券资产管理部常务副总经理,1999年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有限公司总经理。
魏平,董事,硕士,1989年起先后在中国银行上海分行、上海国资财务有限公司、万宝集团、上海波外国际贸易有限公司、莱茵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管理部总经理。
何伟,董事,硕士,14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、黑龙江资产管理部总经理、投资二部总经理等职,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。
王福南,董事,大专,13年证券从业经历。1993年—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,先后任办公室主任、工会主席、行政总监等职。
陈和之,董事,硕士,曾任上海半导体器件二厂财务科会计主管、审计科干部,水利电力局机关财务处主任科员,能源部机关财务处副处长,电力部机关财务局经营财务处处长,国电中兴实业发展总公司主任科员,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在项目投资计划和资产管理工作中,1998年历任上海建信信托投资公司投资基金部副经理、资产信托部总经理。
黄菊成,独立董事,硕士,长期从事金融证券研究和管理,1979年起历任上海财经大学副教授、教授、副院长,1994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年起任上海证券交易所学院院长。

普尔加,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,中国材料所教授,清华大学、中央财大、中国金融学院兼职教授,曾任中国证监会咨询公司总经理。
吴炯,独立董事,博士,著名律师,执业范围包括金融证券,北京中企金通律师事务所合伙人、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。

2.监事会:
魏洁,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,深圳龙岗实业股份有限公司研发管理部总经理,上海国有资产经营有限公司资金管理部副总经理,现任上海国有资产经营有限公司资产管理部总经理。
李雯,监事,硕士。曾任中建一局集团第五建设工程公司宣传干事,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经理。
黄小明,监事,硕士,12年证券从业经历。国泰基金管理有限公司战略管理部副总监,1996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、战略管理部负责人。
3.其他高级管理人员:
陈宏,副总经理,MBA,证券从业年限13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。
陈勇,副总经理,金融学博士后,9年证券从业经历。曾在中国人民银行投资公司投资研究中心主任任职,中国人寿保险公司资金运用中心组合管理处处长,2003年3月起在国泰基金管理有限公司任职,历任总经理助理、副总经理职务。

丁卫海,督察长,硕士,13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,现任公司信息披露负责人、风险控制委员会主任、督察长。

4.基金经理
(1)现任基金经理
金龙债券基金
林勇,男,工商管理硕士,10年证券从业经历。曾任招商银行总行资金交易中心人民币投资管理、首席交易员,嘉实基金管理有限公司基金经理,2004年5月—2006年5月任嘉实债券基金的基金经理,2006年5月起—2006年5月兼任嘉实货币基金的基金经理。2006年5月加盟国泰基金管理有限公司,2006年6月起任国证券投资市场基金的基金经理,现任国泰金龙债券基金的基金经理。
金龙行业基金
陈勇,男,金融学硕士,12年证券从业经历。曾就职于平安集团投资管理研究中心、深圳和利投资发展公司、中期国际信托公司深圳公司,2003年1月加盟国泰基金管理有限公司,先后任国泰基金基金经理助理、国泰基金基金经理。自2006年上半年起主要负责金龙行业精选基金的投资管理工作,目前还兼任金象保本基金、金象保本基金的基金经理。
(2)历任基金经理情况
金龙债券基金
2003年10月至2004年10月,由魏伟勇担任基金经理;2004年11月至2006年10月由何炯担任基金经理;2006年11月至现在由林勇担任基金经理。
金龙行业基金
2003年10月至2006年6月,由崔峰担任基金经理;2006年7月起由黄政担任基金经理。

5.投资决策委员会成员
本基金管理人设有投资决策委员会,由公司总经理、分管投资副总经理以及研究开发部、固定收益部、基金管理部负责人等人组成,督察长列席公司投资决策委员会会议。其主要职责是根据有关法律、基金合同以及公司研究部(和基金小组)提供的研究报告和投资计划,确定基金主要投资策略,审批基金投资计划。

投资决策委员会成员组成如下:
李勇平(总经理)、陈勇(副总经理兼投资总监)、周传根(研究开发部总监)、程江旭(基金管理部副总监)、崔峰(首席基金经理)、高红兵(固定收益部负责人)、程江旭、基金管理部副总监、上述成员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称: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:金运
成立时间:1993年1月9日
组织形式:股份有限公司
注册资本:281.5亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人:张铁英
联系电话:(021)61618888
上海浦东发展银行经过十年来的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快的增长,各项经营指标始终领先股份制商业银行中处于领先水平。截止到2006年6月30日,全行总资产规模已达6302.32亿元人民币,各项存款余额5691.17亿元人民币,各项贷款余额4308.17亿元人民币,2006年上半年,实现净利润16.99亿元人民币,每股收益达0.41元。
上海浦东发展银行总行设资产托管部,资产托管部下设市场发展部、托管运作部、技术保障部、内控管理理四个职能部门,在深圳设立托管分部,现有员工22人。

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
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
传真:(021)23060366
客户服务专线:4008-888-688,(021)33134688
联系人:孙艳丽、陆未定
网址:www.gtfund.com
(2)国泰基金管理有限公司北京理财中心
办公地址:北京市海淀区中关村南大街1号友谊宾馆贵宾楼一层
法定代表人:陈勇
电话:(010)68498852、(010)68498875
传真:(010)68498182
联系人:陈素梅
(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:严仁明
2.代销机构
(1)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
办公地址:上海市浦东南路588号浦发大厦7楼
法定代表人:金运
电话:(021)61618888
联系人:倪苏云
(2)交通银行
住所:上海市银城中路188号
法定代表人:蒋超良
电话:(021)58781234
联系人:曹榕
客服电话:95559

网址:www.bankcomm.com
(3)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
联系人:倪一
联系电话:(021)62580818-213
传真:(021)52910172
联系人:芮筱祺
(4)金通证券股份有限公司
注册地址:浙江嘉兴杭州湾凤起路108号房产大厦9-12层
法定代表人:应云卫
联系电话:(0571)85783743
传真:(0571)85783771
联系人:余少南
(5)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)53594566-4125
传真:(021)53594569
联系人:金宏
(6)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:廖重
联系电话:(021)154033888
传真:(021)164738944
联系人:胡洁瑜

(7)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:黎晓宏
联系电话:(010)65181888
传真:(010)65182261
联系人:秦琦
(8)兴业证券股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路90号标力大厦
法定代表人:兰荣
联系电话:(021)88419974
传真:(06)68419867
联系人:杨皓芳
(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:(010)65182431
传真:(0755)82942112
联系人:林建勇
客户服务电话:900-810-8868
(10)安信证券股份有限公司
办公地址:山东路济南泉城广场180号五层
法定代表人:段锐
联系电话:(0631)6689690
传真:(0631)6689900
联系人:李海海
(12)中国民生证券有限责任公司
(代国泰金龙债券基金)
本基金管理人:北京东城区正义路4号
办公地址:北京东城区正义路4号
法定代表人:严冰平
联系电话:010-58560666-8988
联系人:吴杰
(13)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号国际大厦C座
法定代表人:朱利
联系电话:(010)66568857
传真:(010)66568536
联系人:陈爽
(14)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东大道720号20楼
法定代表人:王梦彬
联系电话:(021)62476601*3019
传真:(021)62476601
联系人:盛云
(15)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座40层
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83195829
传真:(0755)83195949
联系人:李海海
网址:www.cmbchina.com
(16)东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区星阳桥路28号
法定代表人:吴永敏
联系电话:(0512)65881136
传真:(0512)65888021
联系人:方晓梅
(17)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:广州市天河区珠江新城华夏广场36、41和42楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)18765888
传真:(020)187657985
联系人:肖梅
(18)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628号上海证券大厦南楼15-16楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路628号上海证券大厦南楼14楼
法定代表人:王明凯
电话:(021)68816000
传真:(021)68816009
联系人:芮筱祺
(19)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:蒋志高
电话:(021)68801933
传真:(021)68801434
联系人:刘洪

(20)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
联系电话:010-85252605
传真:010-85252655
联系人:杨德华
(21)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:冯立志
联系电话:010-62267799 转 6316
传真:010-62294470
联系人:刘元平
(22)中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市市南区香港东路316号
办公地址:青岛市市南区东海东路28号
法定代表人:史惠民
电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
联系人:丁娜燕
(23)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳福田区益田路1030号海龙王大厦
法定代表人:王明
电话:010-94582866
传真:010-94826560
联系人:陈忠
(24)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:吴万海
电话:025-8447777-721
传真:025-84579979
联系人:袁虹彬
(25)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:胡洁瑜
联系电话:021-83296352
传真:021-51062920
联系人:孙婧
(26)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:张雅峰
联系电话:(0771)56339262
传真:(0771)56339033

(27)注册登记机构
名称: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:上海市黄浦区延安东路700号港泰广场22-23楼
法定代表人:陈勇
电话:(021)33134888
联系人:孙艳丽、陆未定
客服电话:95559
(三)募集设立出具法律意见的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
办公地址: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
电话:(010)58795888
传真:(010)58795899
联系人:王建平、王惠刚
经办律师:王建平、王惠刚
(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
注册地址:上海市浦东新区东昌路668号(邮编:200120)
办公地址:上海湖南路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:汪敏、薛竟

四、基金名称

国泰金龙系列证券投资基金

五、基金的投资目标

契约型开放式

六、基金的投资目标

在保证投资组合低风险和高流动性的前提下,追求较高的当期收入和总回报,力求基金资产的稳定增值。

(一)国泰金龙行业精选基金
在保证投资组合低风险和高流动性的前提下,追求较高的当期收入和总回报,力求基金资产的稳定增值。

(二)国泰金龙行业精选基金
有效把握我国经济的发展趋势,精心选择具有良好行业背景的成长性企业,谋求基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

(一)国泰金龙债券基金
本基金为开放式债券基金,投资范围限于国内依法公开发行的各种固定收益类金融工具和一级市场股票。债券品种主要为国债、金融债、平均AA级以上的企业债、可转换债,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。一级市场股票指网下申购的新股。

(二)国泰金龙行业精选基金
本基金投资于国内依法公开发行的上市的股票、债券及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。保持组合中股票投资比例不高于75%,债券的投资比例不低于20%,其余为现金。其中投资重点是预期具有良好发展态势的处于成长中的成长性上市公司,这部分投资比例将不低于本基金股票资产的80%。

八、投资策略

(一)国泰金龙债券基金
以中长期利率趋势分析为基础,兼顾中短期经济周期、政策方向及收益率曲线分析,通过债券置换和收益率曲线策略等方法,实施积极的债券投资管理,在有效控制利率和信用风险的前提下,为投资者谋求稳定的低风险收益。

在投资策略上,将着重对中长期(3-5年)趋势的分析,防范和规避长期债券的利率风险。所考虑的长期因素有政策因素、国内外产业结构的变化以及利率的变动等。根据对长期趋势的预期来决定组合长期的总体变动范围,进行年度动态调整。根据短期性的经济因素来决定组合内组合久期的变动范围。
可转换债券作为一种附期权结构的债券品种,相应于股票而言,具有低风险低收益的特征。在承担相同风险的状况下,转债的收益较高。在可转债投资方面,本基金将积极参与一级市场的申购,投资转债二级市场时注重企业基本面的分析;短期投资上偏重转债的期权价值,中长期投资上以转债的期权价值和债券价值并重为策略。

(二)国泰金龙行业精选基金
本基金采用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,通过行业优选,确定拟投资的优势行业及相应比例,通过个股选择,挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。

九、业绩比较基准

(一)国泰金龙债券基金
以中信全债指数收益率作为衡量基金业绩的比较基准。
(二)国泰金龙行业精选基金
本基金业绩比较基准是上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均,债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数。
基金业绩比较基准=75%×上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均+25%×上证国债指数。

十、风险收益特征

(一)国泰金龙债券基金
属于收益稳定、风险较低品种。
(二)国泰金龙行业精选基金
承担中等风险,获取相对超额回报。

十一、基金投资组合报告

本系列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。
基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本系列基金基金合同规定,于2007年1月17日复核了本报告中的投资组合报告内容,保证本报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本基金投资组合报告所载数据截止2006年12月31日,本报告所列财务数据未经审计。
国泰金龙系列
1、基金资产组合情况

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	06央行票据44	19,473,437.92	37.64%
2	02国债(14)	7,035,000.00	13.60%
3	20国债(10)	3,015,300.00	5.83%
4	华安转债	3,013,791.00	5.82%
5	20国债(4)	2,528,296.50	4.89%
合计		54,181,127.05	100.00%

2、按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国债券	198,800.00	0.35%
2	金融债	51,303,097.88	94.69%
3	央行票据	1,914,980.00	3.70%
4	可转债	19,473,437.92	37.64%
5	其他资产	10,563,187.36	20.42%
合计		51,303,097.88	98.15%

3、按市值占基金资产净值比例的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	06央行票据44	19,473,437.92	37.64%
2	02国债(14)	7,035,000.00	13.60%
3	20国债(10)	3,015,300.00	5.83%
4	华安转债	3,013,791.00	5.82%
5	20国债(4)	2,528,296.50	4.89%

4、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)其他资产的构成如下:

序号	交易保证金	市值(元)
1	交易保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	782,683.66
3	应收利息	533,017.73
4	应收申购款	64,480.00
合计		1,630,181.39

(3)处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市值(元)	占净值比例
100726	华电转债	579,862.40	1.89%
110874	创业转债	968,250.00	1.08%

(4)本报告期内,本基金未投资资产支持证券。

国泰金龙行业
1、基金资产组合情况

序号	分类	市值(元)	占总资产比例
股票		146,319,019.96	64.44%
债券		46,770,150.00	20.60%
权证		4,793,000.00	2.11%
银行存款和清算备付金		16,940,865.88	7.46%
其他资产		12,258,521.27	5.40%
合计		227,071,567.11	100.00%

2、按行业分类的股票投资组合

序号	行业	市值(元)	占净值比例
1	农林牧渔	2,221,200.00	1.20%
2	采掘业	3,210,800.00	1.74%
3	制造业	59,545,223.40	32.27%
4	食品、饮料	19,948,810.60	10.76%
5	石油、化学、塑胶、塑料	3,613,492.00	1.96%
6	金属、非金属	16,630,116.64	9.02%
7	机械、设备、仪表	10,259,368.16	5.67%
8	医药、生物制品	9,175,444.00	4.97%
9	电力、煤气及水的生产和供应业	2,637,900.00	1.43%
10	建筑业	3,494,010.00	1.89%
11	交通运输、仓储业	9,327,200.00	5.05%
12	信息技术业	16,200,670.28	8.78%
13	批发和零售贸易	6,207,890.00	3.26%
14	金融、保险业	17,436,000.00	9.45%
15	房地产业	9,925,869.29	5.38%
16	社会服务业	11,798,499.92	6.29%
17	传播与文化产业	1,989,800.00	1.08%
18	综合类	2,325,000.00	1.26%
合计		146,319,019.96	79.29%

3、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	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	000896	S双汇	412,325	12,852,170.25	6.96%
2	000623	吉林敖东	225,240	7,455,444.00	4.04%
3	600036	招商银行	440,000	7,198,400.00	3.90%
4	000663	中兴通讯	170,000	6,647,000.00	3.60%
5	600019	宝钢股份	750,000	6,495,000.00	3.52%
6	600016	民生银行	560,000	5,712,000.00	3.10%
7	600258	S百 盛	249,838	4,831,866.92	2.62%
8	600519	贵州茅台	53,645	4,711,640.35	2.55%
9	000402	金 融 街	257,375	4,336,768.75	2.35%
10	601006	大秦铁路	500,000	4,060,000.00	2.19%

4、按券种分类的债券投资组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	000896	S双汇	412,325	12,852,170.25	6.96%
2	000623	吉林敖东	225,240	7,455,444.00	4.04%
3	600036	招商银行	440,000	7,198,400.00	3.90%
4	000663	中兴通讯	170,000	6,647,000.00	3.60%
5	600019	宝钢股份	750,000	6,495,000.00	3.52%
6	600016	民生银行	560,000	5,712,000.00	3.10%
7	600258	S百 盛	249,838	4,831,866.92	2.62%
8	600519	贵州茅台	53,645	4,711,640.35	2.55%
9	000402	金 融 街	257,375	4,336,768.75	2.35%
10	601006	大秦铁路	500,000	4,060,000.00	2.19%

5、更新了的“六、基金的投资”中本基金的申购、赎回费率。
6、更新了的“九、基金的投资”中基金投资组合报告部分为本基金2006年四季度报告的内容。
7、更新了的“十、基金的业绩”,该部分内容均按有关规定编制,并经基金托管人复核,相关财务数据未经审计。
8、更新了的“二十一、对基金份额持有人的服务”,增加了对基金份额持有人的多种服务内容和方式。
9、更新了的“二十二、其他应披露事项”,披露了自上次招股说明书更新截止日以来涉及本本公司的相关公告。
上述内容仅为本更新招股说明书的摘要,详细资料以本更新招股说明书正文所载内容为准。欲查询本更新招股说明书正文,可登录国泰基金管理有限公司网站www.gtfund.com

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国家债券	46,770,150.00	25.34%
合计		46,770,150.00	25.34%

5、按市值占基金资产净值比例的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	20国债(10)	32,665,750.00	17.70%
2	20国债(4)	8,074,400.00	4.38%
3	02国债(14)	6,030,000.00	3.27%

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