国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金

更新招募说明书摘要

(2007 年第一号)

基金管理人:国泰基金管理有限公司　基金托管人:中国银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据 2006 年 8 月 17 日中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]159 号核准募集。基金合同生效日为 2006 年 9 月 29 日。

本基金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审核同意,但中国证监会对本基金作出的任何决定,均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。

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。

投资有风险,投资者投资于本基金时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。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《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》和其他相关法律法规的规定以及《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2007 年 3 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

成立日期: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:陈勇胜

注册资本:1.1 亿元人民币

联系人:孙艳丽

联系电话:(021)33134688

基金管理人股权结构如下:

上海国有资产经营有限公司	24%
国泰君安证券股份有限公司	24%
万联证券有限责任公司	20%
上海爱建信托投资有限责任公司	20%
中国电力财务有限公司	10%
上海仪电控股(集团)公司	2%

(二)基金管理人管理基金的基本情况

截止 2007 年 3 月 31 日,基金管理人共管理 4 只封闭式基金,7 只开放式基金,其中一只为系列基金(包括 2 只子基金),其基本情况如下:

封闭式基金	基金合同生效日期	托管银行
金泰证券投资基金	1998年 3 月 27 日	中国工商银行
金鑫证券投资基金	1999年 10 月 21 日	中国建设银行
金盛证券投资基金	2000年 4 月 26 日	中国建设银行
金鼎证券投资基金	2000年 5 月 16 日	中国建设银行

开放式基金	基金合同生效日期	托管银行
国泰金鹰增长证券投资基金	2002年 5 月 8 日	交通银行
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和国泰金龙债券证券投资基金)	2003年 12 月 5 日	上海浦东发展银行
国泰金马稳健回报证券投资基金	2004年 6 月 18 日	中国建设银行
国泰金象保本增值混合证券投资基金	2004年 11 月 10 日	中国银行
国泰货币市场证券投资基金	2005年 6 月 21 日	中国农业银行
国泰金鹿保本增值混合证券投资基金	2006年 4 月 28 日	中国银行
国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金	2006年 9 月 29 日	中国银行

(三)主要人员情况

1、董事会:

陈勇胜,董事长,硕士,15 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,14 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、延平路证券营业部总经理,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、上海国资财务有限公司、万宝集团、上海波尔强国际贸易有限公司、富景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,14 年证券从业经历。1993 年至 1999 年担任君安证券有限公司总裁助理、总裁办主任、资产管理公司常务副总经理、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、兼企业融资总部总监、收购兼并总部总经理、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。

王耀南,董事,大专,14 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。

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、资产信托总部总经理。

龚浩成,独立董事,硕士。长期从事金融证券研究和管理,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 年起任上证所常务理事,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:

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,深圳龙藩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副总经理,现任上海国有资产经营有限公司资金管理部总经理。

李芝樑,监事,硕士。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,现任中国电力财务有限公司债券基金部经理。

黄永明,监事,硕士,12 年证券从业经历。1995 年起任国泰证券公司行政管理部经理,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 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。

陈甦,副总经理,金融学博士后,9 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,14 年证券从业经历。1994 年起历任国泰证券公司证券发行部副经理,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研究开发部总监,稽核监察部总监,公司督察长。

4、本基金基金经理及相关研究人员配备

(1)现任基金经理

黄刚,男,经济学硕士,14 年证券期货从业经历。曾就职于上海金属交易所、上海期货交易所。2000 年加盟国泰基金管理有限公司,先后任研究开发部经理、市场部经理、金鹰增长基金基金经理、社保基金的基金经理,2007 年 4 月起担任国泰金鹏蓝筹基金的基金经理。

(2)历任基金经理

2006 年 9 月 –2007 年 3 月由冯天戈担任基金经理,2007 年 4 月起由黄刚担任基金经理。

(3)相关研究人员配备

为确保实现基金合同规定的投资目标,本基金专门配备了精通基本面研究和数量分析的研究人员协助基金经理的投资管理工作。研究开发部在对宏观经济发展态势、利率走势和行业个股分析的基础上拟定投资建议;金融工程部负责数量分析,根据历史模拟和风险测算的结果提出投资可行性分析。

5、投资决策委员会

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员组成,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规、基金合同以及公司研究部门和基金小组提供的研究报告和投资计划,确定基金资产投资策略,审批基金投资计划。

投资决策委员会成员组成如下:

李春平(总经理)、陈甦(副总经理兼投资总监)、周传根(研究开发部总监)、何江旭(基金管理部总监)、崔海峰(基金管理部副总监、首席基金经理)、高红兵(固定收益部总监)。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)基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称"中国银行"),基本情况如下:

办公及住所地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人:肖 钢

企业类型:股份有限公司

注册资本:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰千零玖元

存续期间:持续经营

成立日期:1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门总经理:秦立儒

托管部门联系人:宁敏

电话:(010)66594977

传真:(010)66594942

发展概况:

中国银行业务覆盖传统商业银行、投资银行和保险领域,并在全球范围内为个人客户和公司客户提供全面和优质的金融服务,截至 2006 年底,在世界 27 个国家和地区拥有分支机构,与 1500 家国外代理行及 47000 家分支机构保持了代理业务关系,凭借全球化的网络及其优质的服务、雄厚的实力,本行在国内市场保持着独特的竞争优势。

在近百年的岁月里,中国银行以其稳健的经营、雄厚的实力、成熟的产品和丰富的经验深得广大客户信赖,打造了卓越的品牌,与客户建立了长期稳固的合作关系。

中国银行主营商业银行业务,包括公司业务、个人金融业务和资金业务。中国银行向公司客户提供包括贷款、票据贴现、贸易融资、存款、结算、清算、现金管理等各项金融产品和度身定制的财务综合解决方案。中国银行为个人客户提供一系列个人或家庭银行产品及服务,包括储蓄存款、消费信贷、支付结算、银行卡和财富管理等。在多年的发展历程中,中国银行曾创造了中国银行业的许多第一,所创新和研发的一系列金融产品与服务均开创历史之先河,在业界独领风骚,享有盛誉。目前在外汇存贷款、国际结算、外汇资金和贸易融资等领域居于领先地位,且保持了持续快速增长。截至 2006 年底,中国银行境内外分支机构共有 11,241 家,其中境内拥有 37 家一级分行、直属分行,283 家二级分行及 10277 家分支机构,境外分支机构 643 家分行、子公司及代表处,是中国国际化程度最高的银行。中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念,不断向国际化一流大银行的目标迈进。

中国银行有近百年辉煌而悠久的历史,在中国金融史上扮演了十分重要的角色。中国银行于 1912 年由孙中山先生批准成立,至 1949 年中华人民共和国成立的 37 年间,中国银行先后是当时的国家中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行。在动荡的历史年代,中国银行作为民族金融的支柱,以服务大众、振兴民族金融业为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。

新中国成立后,中国银行成为国家指定的外汇外贸专业银行,继续保持和发扬了顽强创业的企业精神,为国家对外经贸发展、开展经济建设作出了贡献。1994 年随着金融体制改革的深化,中国银行由外汇外贸专业银行向功能完善、服务全面的国有商业银行转化,与其它三家国有商业银行一道成为国家金融业的支柱。1994 年和 1995 年,中国银行先后成为香港地区、澳门地区发钞银行。为提高竞争优势,中国银行从 2000 年初开始围绕建立良好的公司治理机制采取了一系列的改革。2001 年,中国银行成功重组了香港中银集团,将 10 家成员银行合并成当地注册的"中国银行(香港)有限公司"。2002 年 7 月,重组后的中国银行(香港)有限公司在香港联交所成功上市,成为国内首家在境外上市的国有商业银行。

2004 年 7 月 14 日,中国银行在与国际同业和国内同业的激烈竞争中,凭借雄厚的实力和优良的服务,脱颖而出,作为我国银行业的优秀代表携手北京 2008 年奥运会,成为北京奥运会唯一的银行合作伙伴。

中国银行于 2003 年被国务院确定为国有独资商业银行股份制改造试点银行,围绕"资本充足、内控严密、运营安全、服务和效益良好、具有国际竞争力的现代化股份制商业银行"的目标,进一步完善符合现代企业制度要求的公司治理机制,稳步推进国有商业银行的股份制改造工作。2004 年 8 月 26 日,中国银行股份有限公司成立,中国银行成为国家控股的股份制商业银行,标志着中国银行向建立良好公司治理机制的现代化股份制商业银行的目标迈进了一大步,中国银行的历史翻开了新的一页。

2006 年 6 月 1 日,中国银行在香港联交所成功挂牌上市,共集资 754.27 亿港元。继成功发行 H 股并上市之后,2006 年 7 月 5 日,中国银行在上海证券交易所成功发行 A 股,是中国资本市场第一家国有商业银行股,是全流通背景下的第一家"海归"股。在国际和国内资本市场同时上市,进一步提高了资本实力,中国银行进入了一个新的发展时期。在势如破竹的中国金融银行业改革的大潮中,在"新兴+转轨"的中国资本市场改革的大趋势中,中国银行将健康、快速、持续发展,创造更新的辉煌、谱写更绚丽的篇章!

中国银行多年来围绕客户需求所做的不懈努力,得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。从 1990 年以来,中国银行一直荣登《财富》500 强排行榜,并被《财富》(中文版)评选为 2006 年最受赞赏的中国公司;自 1992 年,中国银行八次被《欧洲货币》杂志评为"中国最佳银行"或"中国最佳本地银行",并于 2005 年被《欧洲货币》评为中国及香港"最佳商业银行"(2005 年房地产奖项);2004 至 2006 年,中国银行连续三年被《环球金融》杂志评为"中国最佳贸易融资银行"和"中国最佳外汇银行";在中央电视台和《销售与市场》杂志共同主办的"2005 中国营销盛典"中,被评为"2005 年度中国企业营销创新奖"(是获奖企业中唯一的金融企业);根据英国《金融时报》2005 年 8 月进行的调查,中国银行是中国的十大国际品牌之一;另外,中国银行被国家工商总局授予"中国驰名商标"。2006 年在《银行家》杂志"世界 1000 家大银行"中排名第 17 位,被《财资》杂志评为 2006 年度 AAA 奖项中国地区最佳现金管理银行、中国地区最佳贸易融资银行,同时《亚洲货币》杂志也将中国银行评为"中国最佳现金管理银行";被《新兴市场》杂志评为"2006 年亚洲地区年度最佳银行",被《亚洲风险》杂志评为"2006 年度中国最佳银行";获得了《亚洲法律事务》杂志 2006 年"银行和财经服务公司法务组大奖",是国内唯一获得该奖项的金融机构;被《投资者关系》杂志评选为"中国市场企业交易最佳投资者关系"、"香港市场 IPO 最佳投资者关系";在第十四届中国国际金融(银行)技术暨设备展览会上,本行的产品获得"金融业务创新奖";此外,积极推进企业文化建设,营造诚信、绩效、责任、创新、和谐的氛围,于 2005 年,被《中国人才》(《China Staff》)授予"中国大陆'最佳人力资源战略奖'",这是大中华区人力资源管理领域的最高评奖;2006 年再次荣获"优信咨询(Universum)"评选的"大学生心目中最理想雇主奖"。

世纪信誉,环球共享。中国银行将秉承"以客户为中心,以市场为导向,强化公司治理,追求卓越效益,创建国际一流大银行"的宗旨,依托其雄厚的实力、遍布全球的分支机构、成熟的产品和丰富的经验,竭诚为客户提供全方位、高品质的银行服务,与广大客户携手共创美好未来。

财务概况:

2006 年,中国银行资产总额 53252.73 亿元人民币,股东权益(不含少数股东权益)合计 3882.54 亿元人民币,分别比上年增长 12.28%和 66.03%,实现净利润 418.92 亿元人民币,比上年增长 52.38%,总资产回报率和权益净回报率分别达到 0.94%和 13.86%,同比提高 0.22 个百分点和 0.70 个百分点;资产质量持续改善,2006 年末不良贷款比率从 2005 年末的 4.62%进一步下降到 4.04%,下降 0.58 个百分点,资本充足率为 13.59%,核心资本充足率为 11.44%,分别较上年增加 3.17 个百分点及 3.36 个百分点。

(二)主要人员情况

肖钢先生,自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自 2003 年 3 月起任中国银行董事长、党委书记、行长,自 1996 年 10 月起任中国人民银行行长助理,期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989 年 10 月至 1996 年 10 月,历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于 1958 年 8 月,1981 年毕业于湖南财经学院,1996 年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生,自 2004 年 8 月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002 年 9 月至 2004 年 8 月担任海南省副省长。1994 年 7 月至 2002 年 9 月担任中国工商银行副行长。1988 年至 1994 年 7 月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于 1952 年 5 月,1977 年毕业于厦门大学经济系财政金融专业,1999 年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

王永利先生,自 2006 年 8 月起担任中国银行股份有限公司副行长。自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司行长助理,自 2003 年 11 月起任中国银行副行长。1997 年 4 月至 2003 年 11 月历任中国银行财务部、资产负债管理部副总经理、总经理、福建省分行常务副行长及行长,以及河北省分行行长等职。王先生出生于 1964 年 4 月,1987 年毕业于中国人民大学,2005 年获得厦门大学博士学位。

秦立儒先生,自 2005 年 10 月起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。2005 年 5 月至 2005 年 10 月任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部负责人。2004 年 4 月至 2005 年 5 月任中国银行股份有限公司全球金融市场部总经理。2002 年 7 月至 2004 年 4 月任中国银行(香港)有限公司资金部总经理;1999 年 6 月至 2002 年 7 月任香港中银集团外汇交易中心总经理;1997 年 9 月至 1999 年 6 月任广东省银行香港分行(香港中银集团)总经理;1995 年 11 月至 1997 年 9 月任中国银行总行资金部副总经理,主管全球资金交易;1991 年 5 月至 1995 年 11 月历任中国银行纽约分行资金部经理、助理总经理、副总经理;1987 年 10 月至 1991 年 5 月历任中国银行总行资金部副处长、处长;1982 年 8 月至 1987 年 9 月任中国银行卢森堡分行外汇部经理;1978 年 2 月至 1982 年 7 月,先后在中国银行总行财会部、中国银行伦敦分行、卢森堡分行从事资金交易工作。秦先生出生于 1955 年 5 月,1978 年毕业于北京外贸学院。

(三)证券投资基金托管情况

截止到 2007 年 3 月末,中国银行已托管景宏、同盛、兴安、同智优势成长、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达策略成长二号、易方达积极成长、易方达货币市场、易方达月月收益、易方达深证 100 交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列(含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券)、嘉实货币市场、嘉实沪深 300 指数、嘉实超短债、嘉实主题精选、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币市场、海富通股票、万家 180 指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏回报二号、华夏大盘精选、景顺长城景系列(含景顺长城动力平衡、景顺长城货币市场、景顺长城优选股票)、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、泰信优质生活、招商先锋、大成蓝筹稳健、大成财富管理 2020、泰达荷银行业精选、国泰金象保本增值、国泰金鹿保本增值混合、国泰金鹏蓝筹价值、友邦华泰盛世中国、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合、华宝兴业先进成长股票型、国海富兰克林潜力组合基金等 49 只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型等多种类型的基金和理财品种,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于 1998 年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类,中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队;并在上海市分行、深圳市分行设立托管业务团队。

中国银行托管及投资者服务部现有员工 90 余人,其中硕士学历以上人员 21 人,具有一年以上海外工作和学习经历的人员有 10 余人。

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

地址:上海市黄浦区延安东路 700 号港泰广场 22–23 楼

电话:(021)23060330

传真:(021)23060372

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

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

负责人:吴畏

电话:(010)68498575

传真:(010)68498182

联系人:隋素梅

(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)23060367

联系人:严仁明

2、代销机构

(1)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

客户服务电话:95566

传真:(010)66594946

联系人:客户服务中心

(2)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

法定代表人:郭树清

客服电话:95533

(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

法定代表人:祝幼一

联系电话:(021)62580818–213

传真:(021)52610172

联系人:芮敏祺

(4)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)65183888

传真:(010)65182261

联系人:徐翼

(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)53858549

联系人:金芸

(6)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:朱利

联系电话:(010)66568587

传真:(010)66568536

联系人:郭京华

(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 号国信房产大厦 9–12 层

法定代表人:应上歌

联系电话:(0571)85783743

传真:(0571)85783771

联系人:余少南

(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:丁国荣

联系电话:(021)54033888

传真:(021)54038844

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)82943141

传真:(0755)82943121

联系人:曾兴华

(10)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:王益民

联系电话:(021)62476600*3019

传真:(021)62474651

联系人:盛 云

(11)东吴证券股份有限公司

注册地址:苏州市石路爱河桥路 28 号

法定代表人:吴永敏

联系电话:(0512)65581136

传真:(0512)65588021

联系人:方晓丹

(12)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

联系电话:(021)68419974

传真:(021)68419867

联系人:杨盛芳

(13)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

电话:(020)87555888

传真:(020)87557985

联系人:肖中梅

(14)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

电话:021–66508063

传真:021–65081434

联系人:刘永

客户服务电话:021–962518

(15)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:汤士生

联系电话:010–62267799 转 6316

传真:010–62294470

联系人:刘元平

(16)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:杨甦华

(17)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:管荣升

电话:(0791)6289771

传真:(0791)6289395

联系人:万齐志

(18)中信证券有限责任公司

注册地址:深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

法定代表人:王东明

电话:010–84588266

传真:010–84865560

联系人:陈忠

(19)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

办公地址:上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 14 楼

法定代表人:王明权

电话:(021)68816000

传真:(021)68815009

联系人:刘晨

(20)渤海证券有限责任公司

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

电话:(022)28451883

传真:(022)28451616

联系人:徐焕强

(21)万联证券有限责任公司

注册地址:广州市东风东路 836 号东峻广场 3 座 5、34、35 楼

法定代表人:李舫金

联系电话:020–87691111

传真:020–87691530

联系人:何勇峰

(22)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

联系电话:0755–82130833

传真:0755–82133302

联系人:林建闽

(23)华泰证券证券有限责任公司

注册地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

联系电话:025–84457777–721

联系人:袁红彬

(24)长江证券证券有限责任公司

注册地址:武汉市新华路特 8 号

法定代表人:胡运钊

联系电话:021–63296362

传真:021–51062920

联系人:甘露

(25)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

联系电话:0532–85022026

传真:0532–85022026

联系人:丁韶燕

(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:张雅锋

联系电话:(0771)5539262

传真:(0771)5539033

联系人:覃清芳

(27)北京银行股份有限公司

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:010–66226044/010–66223251

传真:010–66226045/010–66226047

客户服务热线:010–96169

(二)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

(三)出具法律意见书的律师事务所

律师事务所:上海源泰律师事务所

注册地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人:廖海

电话:021–51150298

传真:021–51150398

联系人:吕红

经办律师:廖海、吕红

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址:上海市浦东新区东昌路 568 号

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

电话:(021)61238888

传真:(021)61238800

联系人:陈兆欣

经办注册会计师:汪棣、陈宇

四、基金名称

国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式基金

六、基金的投资目标

本基金将坚持并深化价值投资理念。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的稳定增值,力争获取更高的超额市场收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为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、现金、短期金融工具、权证、资产支持证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。其中债券投资的主要品种包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的 35%–95%,债券以及包括权证和资产支持证券在内的其他证券资产占基金资产的 0–60%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

八、投资策略

1、大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济环境、证券市场走势的分析,预测未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险与收益水平,结合基金合同的资产配置范围组合投资止损点,借助风险收益规划模型,得到一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置:战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险,然后确定最能满足各类基金风险 – 回报率目标的资产组合;战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率不同,预测短期性回报率,调整资产配置,获取市场时机选择的超额收益。本基金的资产配置主要采用定量分析与定性分析相结合的方法。

在定量分析方面,主要采用均衡市盈率预测模型,并参考其他相关指标。均衡市盈率模型的思路是通过测算 A 股市场理论上均衡的市盈率水平,然后将其与 A 股市场整体、基金股票池的实际市盈率水平进行比较,来判定股票市场系统性风险的高低,最后则根据理论值与实际值的差异程度来决定资产配置中股票资产的配置比例。另外,本基金还参照股息率、收益率差距表(1/PE– 银行利率)等指标,来判断股市是否处于合理水平。

在定性分析方面,主要对可能影响市场走势的相关因素进行定性分析,并对根据定量模型作出的资产配置方案进行修正。定性因素涉及很多方面,主要包括国家宏观经济和证券市场政策、利率和汇率政策、国家政治环境、资本项目外汇管理政策、市场参与主体的诚信程度等。

2、股票资产投资策略

本基金的股票资产投资采取核心 – 卫星投资策略(Core–Satellite strategy),核心投资主要以新华富时蓝筹价值 100 指数所包含的成分股以及备选成分股为标的,构建核心股票投资组合,以期获得市场的平均收益(benchmark performance),这部分投资至少占基金股票资产的 80%;同时,把握行业周期轮动、市场时机等机会,通过自下而上、精选个股、积极主动的卫星投资策略,力争获得更高的超额市场收益(outperformance)。

(1)　核心股票资产投资策略

本基金的核心股票投资策略主要以新华富时蓝筹价值 100 指数所包括的成分股以及备选成分股为选股池,采取增强型的指数跟踪技术。即以抽样复制的形式,在核心股票选股池中选取一定数量的个股进行投资,使核心股票的投资表现和新华富时蓝筹价值 100 指数的表现在一定范围内联动,因核心股票收益率基本跟踪新华富时蓝筹价值 100 指数的收益率。

(2)　卫星股票资产投资策略

本基金的卫星股票投资策略将充分发挥基金经理人在主动投资上具有的优势,着眼于企业的未来盈利水平,选取预期成长性强,并能将成长转换成实实在在收益的个股,与核心股票组合形成互补,卫星股票组合对于整个基金的股票组合来说能起到增加超额收益、降低组合风险的作用。本基金通过成长因子来筛选成长性股票,成长因子主要包括以下指标:

1) 总资产增长率

2) 主营业务增长率

3) 净利润增长率

4) 资产回报增长率

以上四个指标按一定的权数加权平均,形成一个复合型的成长因子,能够更为全面地判断企业的成长性。

3、债券资产投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券置换和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。

(1)以对长期利率预期为基础确定期限结构。在预期利率下降时,增加组合久期,提高债券价格上升产生的收益;在预期利率上升时,减小组合久期,降低债券价格下降产生的损失。如果预期市场收益率曲线作强烈的整体向上平移,降低债券组合的整体持仓比例,同时降低组合久期,来使组合损失降到最低。

(2)以收益率曲线分析为基础确定收益率曲线配置。根据收益率曲线可能发生变动的种类,如平坦化、陡峭化、正向蝴蝶型、反向蝴蝶型等,通过子弹形、哑铃形和梯形等配置方法,在短、中、长期债券间确定比例,以期从短、中、长期债券的相对价格差中取得收益。

(3)以相对利差分析为基础确定类属配置。通过对各类属债券历史利差的数量化分析,寻找市场投资机会。比如在预期国债与金融债利差缩小时,卖出国债,买入金融债。

(4)以流动性分析和收益率分析为基础确定市场配置。交易所国债市场发行总量较小,大额交易流动性较差、小额交易流动性较好,而银行间国债市场发行总量较大,大额交易成本低,某些时段流动性较好。故根据不同时段对流动性的不同需求,在两个市场间配置债券资产。

在通过上述配置方法构建债券组合之后,本基金在出现以下情况时对债券投资组合进行动态调整:

(1)短期经济运行指标、如短期通货膨胀率、短期名义利率、汇率等发生变动,引起的市场实际利率的变动;

(2)中长期国内通货膨胀预期的变动引起中长期利率走势变动,导致整个投资组合重新估价;

(3)央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向,从而引起债券市场结构性调整;

(4)债券一级市场上的发行方式创新及新债定价与认购情况发生变化,导致二级市场收益率产生波动;

(5)由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价;

(6)市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动;

(7)单个券种或某一类别债券的定价偏差,也就是市场失衡导致的投资机会等。

九、业绩比较基准

业绩比较基准 =60%* 新华富时蓝筹价值 100 指数 +40%* 新华雷曼中国债券指数

本基金的股票业绩比较基准为新华富时蓝筹价值 100 指数,债券业绩比较基准为新华雷曼中国债券指数。

如果业绩比较基准中的指数被停止编制或发布,或由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更而导致指数不宜继续作为本基金的业绩比较基准,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则变更本基金的业绩比较基准,并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

本基金由于上述原因变更基准指数,无须经基金份额持有人大会决议通过,在与基金托管人协商一致并履行合适程序后,于正式实施变更前 2 日内在中国证监会指定的媒体上予以公告。

新华财通投资咨询(北京)有限公司,新华富时指数有限公司,FTSE 国际有限公司,新华财经有限公司,伦敦证券交易所和金融时报有限公司并未以任何形式发起、认可、销售和推广国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资