国泰金马稳健回报证券投资基金

更新招募说明书摘要

(2007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2007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:陈勇胜

注册资本:1.1亿元人民币

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%

信息披露负责人:丁昌海

联系电话:(021)23060288转

(二)基金管理人管理基金的基本情况

截至2007年12月31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、国泰金鹏价值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2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。

(三)主要人员情况

1、董事会成员:

陈勇胜,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。

陈良秋,董事,大学本科,律师。1993年7月起在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。

刘晶,董事,博士,高级经济师。1997年4月起在建设银行总行工作,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。

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。

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年至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、行政总监等职。

金旭,董事,法学硕士,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月担任国泰基金管理有限公司总经理。

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、监事会成员:

万树斌,监事会主席,大学本科,高级会计师。1984年起在建设银行总行工作,历任会计部副处长、计财部副处长、处长、资倩部高级经理。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。

黄晓坤,监事,博士,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。

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。

王骏,监事,硕士,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,一直从事基金登记核算工作,现任运营管理部副总监(主持工作)。

朱小川,监事,博士,曾任Lehman, Lee & Xu律师事务所、中天律师事务所律师,东海证券有限公司合规审查员,2004年8月加入国泰基金管理有限公司,现任稽核监察部法务主管。

3、高级管理人员:

陈勇胜,董事长,见董事会成员介绍。

金旭,总经理,见董事会成员介绍。

陈甦,副总经理,金融学博士后,10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、本基金的基金经理及助理:

(1)现任基金经理及助理

基金经理　何江旭,男,经济学硕士,14年证券期货从业经历。曾就职于浙江金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,基金管理部副总监,2002年11月至2004年7月担任基金金鑫基金经理,2003年1月至2004年3月担任基金金鼎基金经理,2004年6月起担任国泰金马稳健回报基金的基金经理,2007年3月起兼任金鹰增长基金的基金经理,并兼任基金管理部总监,2007年5月起兼任国泰金牛创新基金的基金经理。

基金经理助理　王航,男,应用金融学硕士,CFA,11年证券基金从业经验。1997至2000年就职于南方证券有限公司投资银行部,任高级经理;2003年加入国泰基金管理有限公司,任社保111组合基金经理助理,2007年2月至10月兼任国泰金鹿、国泰金象保本基金经理助理,2007年10月起兼任国泰金马稳健回报基金的基金经理助理。

(2)历任基金经理

自本基金成立以来一直由何江旭担任基金经理,无基金经理更换事项。

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、投资总监、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:

金旭(总经理)、余荣权(投资总监)、陈甦(投资总监)、周传根(研究开发部总监)、何江旭(基金管理部总监)、高红兵(固定收益部总监)。丁昌海(督察长)列席会议。

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)基金托管人情况

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:贰千叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

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)67595003

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)。截至2007年9月30日止,中国建设银行总资产达人民币64,060.41亿元,比上年末增加人民币9,575.30亿元,增长17.57%;总负债人民币60,161.19亿元,比上年末增加人民币8,978.12亿元,增长17.54%。客户贷款及垫款人民币31,731.02亿元,比上年末增加人民币3,772.19亿元,增长13.49%;客户存款人民币51,938.00亿元,比上年末增加人民币4,725.44亿元,增长10.01%。2007年1-9月中国建设银行实现净利润人民币571.01亿元,每股收益为人民币0.25元。核心资本充足率为10.60%,资本充足率为12.53%。(备注:以上财务数据未经审计)

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8月24日,中国建设银行在香港与美国银行签署协定,收购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,并于2006年12月29日完成收购交割,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”。中国建设银行被《环球金融》杂志评选为“亚洲最佳新兴市场银行奖-2007年度中国最佳银行”,被《财资》杂志评选为“2007年度最佳公司治理企业”,荣获《亚洲银行家》“中国房屋按揭贷款业务成就奖”。在《上海证券报》主办和北京大学光华管理学院提供学术支持的“2006影响中国—上市公司系列评选”活动中,中国建设银行荣获“2006最具影响力的中国海外上市公司”称号。在中国信息协会、亚洲客户服务协会等机构主办的“2006-2007中国最佳客户服务”评选活动中,中国建设银行荣获“中国最佳客户服务奖”、“中国客户服务突出贡献荣誉奖”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、QFII/QDII营运团队、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资委托托管团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队等11个职能处室,现有员工110余人。

(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、国际业务部工作,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。

(三)基金托管业务经营情况

截止到2007年12月31日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、鸿飞、银丰等8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、工银瑞信债券、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、交银施罗德蓝筹等55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:尤艳、蔡彦林	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	
		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

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	中国农业银行	注册地址:北京市东城区建国门内大街69号	
		办公地址:北京市东城区建国门内大街69号	
		法定代表人:项俊波	客服电话:95599
		联系人:蒋浩	网址:www.95599.cn
3	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
4	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:蒋超良	客服电话:95559
		联系人:张咏东	电话:021-58781234
		网址:www.bankcomm.com	
5	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
		客服电话:95555	网址:www.cmbchina.com
6	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	
		办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号	
		法定代表人:陶礼明	电话:11185
		联系人:陈春林	传真:010-66415194
		网址:www.cpsrb.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:徐伟、汤嘉惠	客户服务热线:95528
		网址:www.spdb.com.cn	
8	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:021-62580818-213	传真:021-62152814
		网址:www.gtja.com	
9	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:010-62267799-6416	传真:010-62294470
		网址:www.ehongyuan.com	
10	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:010-65183888	传真:010-65182261
		网址:www.csc108.com	
11	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:021-53594566	传真:021-53858549
		网址:www.htsec.com	
12	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	联系人:李俊
		电话:020-37865026	传真:020-87691530
		网址:www.wlzq.com.cn	
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
14	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:龚晓军
		电话:0571-85783750	传真:0571-85783771
		网址:www.bigsun.com.cn	
15	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:021-54038844	传真:021-54038844
		网址:www.sw2000.com.cn	
16	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:0755-82940141
		网址:www.newone.com.cn	
17	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
		网址:www.dfzq.com.cn	
18	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	联系人:方晓丹
		电话:0512-65581136	传真:0512-65588021
		网址:www.dwzq.com.cn	
19	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	
20	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	
		法定代表人:王志伟	联系人:肖中梅
		电话:020-87555888	传真:020-87557985
21	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	联系人:徐美云
		电话:0791-6285337	传真:0791-6289395
		网址:www.gsstock.com	
22	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:张颢
		电话:010-85252664	传真:010-85252655
		网址:www.mszq.com	
23	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:王明权	联系人:刘晨
		电话:021-68816000	传真:021-68815009
		网址:www.ebscn.com	
24	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
		网址:www.zxwt.com.cn	
25	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	联系人:陈忠
		电话:010-84588266	传真:010-84865560
		网址:www.ecitic.com	
26	华泰证券有限责任公司	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:樊昊
		电话:025-84457777	网址:www.htzq.com.cn
27	长江证券股份有限公司	注册地址:武汉市新华路特8号	
		法定代表人:胡运钊	联系人:李良
		电话:021-63219781	传真:021-51062920
		客服热线:4008-888-999	网址:www.cjsc.com
28	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
		客服热线:4008888100(全国)、96100(广西)	
		网址:www.ghzq.com.cn	
29	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	联系人:陈庆燕
		电话:022-28451700	传真:022-28451892
		网址:www.ewww.com.cn	
30	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:400-8888-555,0755-25125666	
		网址:www.lhzq.com	
31	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
32	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	联系人:林建闽
		电话:0755-82130833	传真:0755-82133302
33	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:何如	联系人:傅咏梅
		电话:0755-82130833	传真:0531-81283735
		客服热线:95538	

(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)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	联系人:陈兆欣
		电话:021-61238888	传真:021-61238800
		经办注册会计师:汪棣、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1月18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2007年12月31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	6,692,467,599.58	65.58%
债券	2,156,735,000.00	21.13%
权证	38,082,400.00	0.37%
银行存款和结算备付金	1,248,437,227.53	12.23%
其他资产	69,440,767.64	0.68%
合计	10,205,162,994.75	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	110,739,669.56	1.10%
2	采掘业	282,829,867.00	2.81%
3	制造业	2,070,728,473.74	20.55%
	其中:食品、饮料	356,312,873.15	3.54%
	纺织、服装、皮毛	591,510.40	0.01%
	木材、家具	9,689,513.79	0.10%
	造纸、印刷	93,868,854.00	0.93%
	石油、化学、塑胶、塑料	118,026,883.93	1.17%
	电子	37,843,470.40	0.38%
	金属、非金属	358,563,992.40	3.56%
	机械、设备、仪表	694,694,882.34	6.90%
	医药、生物制品	329,565,855.03	3.27%
	其他制造业	71,570,638.30	0.71%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	382,949,621.92	3.80%
5	建筑业	147,910,589.06	1.47%
6	交通运输、仓储业	473,643,222.85	4.70%
7	信息技术业	811,821,209.89	8.06%
8	批发和零售贸易	510,295,093.93	5.07%
9	金融、保险业	1,111,246,615.29	11.03%
10	房地产业	292,771,338.04	2.91%
11	社会服务业	121,811,855.03	1.21%
12	传播与文化产业	121,264,326.48	1.20%
13	综合类	254,455,716.79	2.53%
	合计	6,692,467,599.58	66.43%

(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	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	600050	中国联通	25,435,415	307,259,813.20	3.05%
2	600900	长江电力	15,670,352	305,415,160.48	3.03%
3	600100	同方股份	4,998,918	230,000,217.18	2.28%
4	600030	中信证券	2,369,766	211,549,010.82	2.10%
5	600036	招商银行	5,328,593	211,172,140.59	2.10%
6	600153	建发股份	7,800,101	202,256,618.93	2.01%
7	600000	浦发银行	2,964,359	156,518,155.20	1.55%
8	000002	万科A	5,326,151	153,606,194.84	1.52%
9	600316	洪都航空	4,000,669	152,785,549.11	1.52%
10	601318	中国平安	1,428,846	151,600,560.60	1.50%

(四)报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	金融债券	626,700,000.00	6.22%
2	央行票据	1,530,035,000.00	15.19%
	合计	2,156,735,000.00	21.41%

(五)报告期末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)	占资产净值比例
1	07央行票据18	670,335,000.00	6.65%
2	07央行票据81	289,680,000.00	2.88%
3	07农发18	200,300,000.00	1.99%
4	05央行票据46	199,740,000.00	1.98%
5	05农发12	197,680,000.00	1.96%

(六)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)
存出保证金	3,205,049.10
应收证券清算款	19,877,514.45
应收利息	37,930,325.94
应收申购款	8,427,878.15
合计	69,440,767.64

4、本报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

5、本报告期末本基金持有的权证明细如下:

权证代码	权证名称	数量(份)	成本(元)
030002	五粮YGC1	800,000	26,829,604.81
合计		800,000	26,829,604.81

6、本报告期内本基金未投资资产支持证券。

7、由于四舍五入原因,分项之合与合计可能有尾差。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2007年12月31日,并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2004年6月18日至2004年12月31日	-3.50%	0.62%	-6.93%	0.81%	3.43%	-0.19%
2005年	-0.31%	0.90%	1.18%	0.82%	-1.49%	0.08%
2006年	128.01%	1.27%	75.25%	0.86%	52.76%	0.41%
2007年	113.20%	1.88%	54.80%	1.32%	58.40%	0.56%
自基金合同生效至今	367.64%	1.33%	155.47%	1.01%	212.17%	0.32%

十三、基金费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、证券交易费用;

4、基金信息披露费用(国家另有规定的从其规定);

5、基金份额持有人大会费用;

6、与基金相关的会计师费和律师费(国家另有规定的从其规定);

7、照国家有关规定可以列入的其它费用。

(二)基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

2、基金托管费

本基金应给付基金托管人托管费,按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3、上述(一)中3到7项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(三)与基金销售