

国泰金鹏蓝筹价值混合证券投资基金

2006 年年度报告

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

送出日期：二〇〇七年三月三十日

重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）根据本基金合同规定，于2007年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期间：2006年9月29日至2006年12月31日。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

目录

内容	页码
重要提示.....	1
一、基金简介.....	2
二、主要财务指标、基金净值表现及基金收益分配情况.....	4
三、管理人报告.....	6
四、托管人报告.....	8
五、审计报告.....	8
六、财务会计报告.....	10
七、基金投资组合报告.....	20
八、基金份额持有人情况.....	24
九、开放式基金份额变动情况.....	24
十、重大事件揭示.....	24
十一、备查文件.....	26

一、基金简介

（一）基金基本资料

1、基金名称：	国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金
2、基金简称：	国泰金鹏蓝筹
3、基金交易代码：	020009
4、基金运作方式：	契约型开放式
5、基金合同生效日：	2006年9月29日
6、报告期末基金份额总额：	1,233,692,938.28份
7、基金合同存续期：	无限期
8、基金份额上市的证券交易所：	无
9、上市日期：	无

（二）基金产品说明

1、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。
2、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。 （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)。 （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。
3、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。
4、风险收益特征：	本基金属于中等风险的证券投资基金品种，基金在获取市场平均收益的同时，力争获得更高的超额收益。

（三）基金管理人

- | | |
|------------|--|
| 1、名称： | 国泰基金管理有限公司 |
| 2、注册地址： | 上海市浦东新区峨山路91弄98号201A |
| 3、邮政编码： | 200127 |
| 4、办公地址： | 上海市延安东路700号港泰广场22-23楼 |
| 5、邮政编码： | 200001 |
| 6、国际互联网址： | www.gtfund.com |
| 7、法定代表人： | 陈勇胜 |
| 8、总经理： | 李春平 |
| 9、信息披露负责人： | 丁昌海 |
| 10、联系电话： | 021-23060282 |
| 11、传真： | 021-23060283 |
| 12、电子邮箱： | xinxipilu@gtfund.com |

（四）基金托管人

- | | |
|------------|--|
| 1、名称： | 中国银行股份有限公司 |
| 2、注册地址： | 北京西城区复兴门内大街1号 |
| 3、办公地址： | 北京西城区复兴门内大街1号 |
| 4、邮政编码： | 100818 |
| 5、法定代表人： | 肖钢 |
| 6、国际互联网址： | www.boc.cn |
| 7、信息披露负责人： | 宁敏 |
| 8、联系电话： | 010-66594977 |
| 9、传真： | 010-66594942 |
| 10、电子邮箱： | tgxxpl@bank-of-china.com |

（五）信息披露

- | | |
|----------------------|---|
| 1、信息披露报纸名称： | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 2、登载年度报告正文的管理人互联网网址： | http://www.gtfund.com |
| 3、基金年度报告置备地点： | 上海市延安东路700号港泰广场22-23楼 |

（六）其他有关资料

- | | |
|-------------|---------------------------|
| 1、聘请的会计师事务所 | |
| 名称： | 普华永道中天会计师事务所有限公司 |
| 办公地址： | 上海市湖滨路202号普华永道中心8楼 |
| 2、基金注册登记机构 | |
| 名称： | 国泰基金管理有限公司登记注册中心 |
| 办公地址： | 上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼 |

二、主要财务指标、基金净值表现及基金收益分配情况

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（一）主要会计数据和财务指标

序号	主要会计数据和财务指标	2006年9月29日至2006年12月31日
1	基金本期净收益	97,951,607.52元
2	加权平均基金份额本期净收益	0.0775元
3	期末可供分配基金收益	3,347,645.52元
4	期末可供分配基金份额收益	0.0027元
5	期末基金资产净值	1,554,865,475.90元
6	期末基金份额净值	1.260元
7	基金加权平均净值收益率	7.20%
8	本期基金份额净值增长率	34.59%
9	基金份额累计净值增长率	34.59%

注：本基金合同生效日为2006年9月29日，本报告期的主要财务指标的计算期间为2006年9月29日至2006年12月31日。

（二）基金净值表现

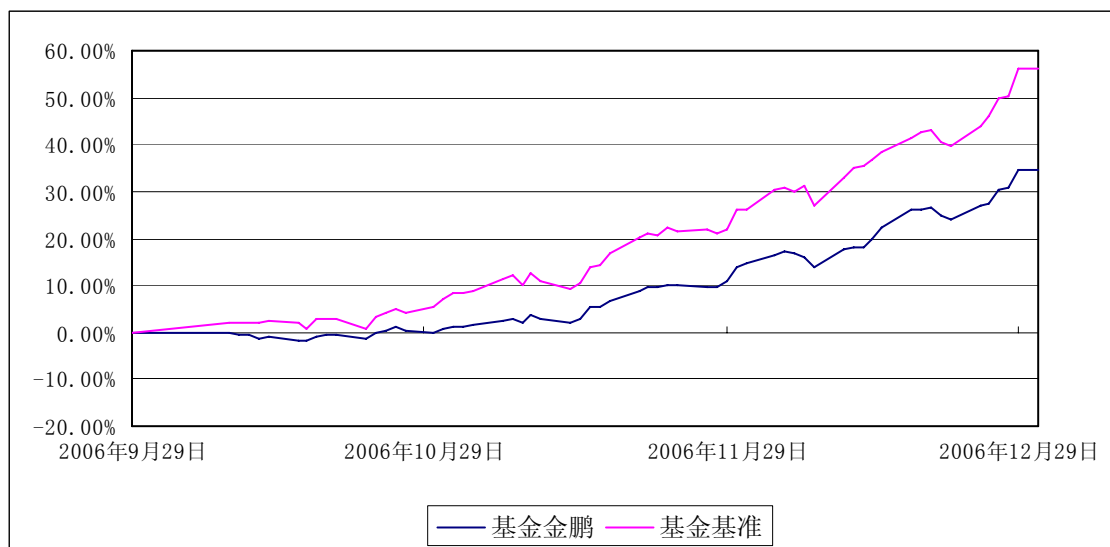
1、报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	34.59%	1.14%	56.28%	1.54%	-21.69%	-0.40%
自基金成立起至今	34.59%	1.13%	56.28%	1.53%	-21.69%	-0.40%

注：本基金建仓期为六个月，截至报告期末，本基金尚处于建仓期中。

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较：

基金金鹏累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年9月29日至2006年12月31日)

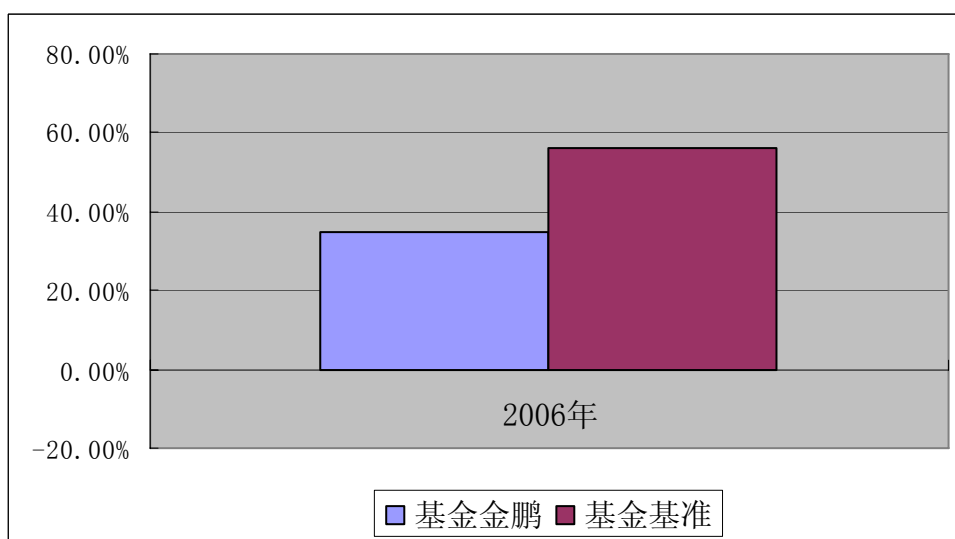


注：1、本基金合同生效日为2006年9月29日，截止至2006年12月31日不满一年。

2、根据本基金合同，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。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%。本基金建仓期为六个月，截至报告期末，本基金尚处于建仓期中。

3、自基金合同生效以来每年净值增长率与同期业绩比较基准的收益率比较：

基金金鹏净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



（三）收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数	备注
2006年	0.750元	分红两次
合计	0.750元	

三、管理人报告

（一）基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日，是经中国证监会证监基字[1998]5号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京设有分公司。

截至2006年12月31日，本基金管理人共管理4只封闭式证券投资基金：基金金泰、基金金鑫、基金金盛、基金金鼎，以及7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、国泰金象保本增值混合证券投资基金、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、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金等。另外，本基金管理人于2004年获得社保基金委托资产管理人资格，目前受托管理社保基金投资组合。

2、基金经理或基金经理小组简介

冯天戈，男，经济学硕士，12年证券从业经历。曾就职于海南深海期货公司，海南富岛资产管理公司，长城基金管理有限公司基金经理助理，2003年加盟国泰基金管理有限公司，曾任国泰金鹰增长基金基金经理助理，2004年3月起担任国泰金鹰增长基金的基金经理，2006年9月起兼任国泰金鹏蓝筹基金的基金经理。

（二）对报告期内基金运作的合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

报告期内本基金未发生任何损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场 and 不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障了投资人的合法权益。

（三）报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

2006年是中国证券市场极不平凡的一年。在股权分置改革和人民币汇率改革的大背景下，中国A股市场终于一洗多年的颓势，上证指数、深证成指均创出了历史新高。不仅如此，沪深两市年市值规模增加速度居全球第一，沪深两市年融资规模创历史之最，这些数据都充分显示了A股市场的欣欣向荣。

回顾2006年的市场表现，股权分置改革和A股的价值重估可谓是推动上半年行情最为重要的两个因素，而下半年市场关注点则开始转向公司盈利增长，上市公司中期业绩出人意外的止跌回升以及三季度业绩的大幅增长直接推动了8月末至年底的新一轮上涨行情。从市场的投资热点来看，人民币汇率改革是贯穿全年的投资线索。

截止报告期末，本基金份额净值为1.260元，本报告期份额净值增长率为34.59%，同期业绩比较基准增长率为56.28%。本基金建仓期为六个月，截至报告期末，本基金尚处于建仓期中。

（四）对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

展望2007年，我们相信A股市场将续写2006年的辉煌，企业盈利增长将成为推动股指上涨的主要因素。宏观经济方面，我们认为不会出现大的波动。影响中国经济这一轮上升周期的因素并没有消失，国际经济环境依然良好，2007年也许会重复这几年经济运行超预期的历史。微观经济方面，强劲的经济增长将直接体现在企业盈利的大幅增长，上市公司盈利将不断超出市场预期。股权分置改革、税制改革、股权激励、优质新股加入等将成为企业盈利增长的主要因素。在投资方向上，我们认为经济增长的结构性变化、人民币升值、周期性行业的价值重估、税制改革是2007年证券市场最主要的投资方向。另外奥运、3G等因素有可能成为阶段性的投资主题。行业方面，我们主要看好金融、地产、食品饮料、零售、装备制造、钢铁行业，另外还看好酒店旅游、交通运输、传媒等行业；在风格特征方面，我们看好大盘蓝筹股。

（五）基金内部监察报告

本报告期内，本基金管理人在继续完善内部控制制度和流程体系的同时，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

- 1、开展对公司各项业务的日常监察业务，对公司内部不当业务行为和风险隐患做到及时发现、及时查处，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规。

- 2、进一步优化公司内控和风险管理体系，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

- 3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

2007年本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，并在完善内部控制体系、有效

防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

四、托管人报告

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国泰金鹏蓝筹价值证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

五、审计报告

国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金(以下简称“国泰金鹏蓝筹价值基金”)会计报表，包括2006年12月31日资产负债表、2006年9月29日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间的经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是国泰金鹏蓝筹价值基金的基金管理人国泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了国泰金鹏蓝筹价值基金2006年12月31日的财务状况以及2006年9月29日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师：汪棣

中国·上海市
2007年3月26日

注册会计师：陈宇

六、财务会计报告

(一) 基金会计报表

1、资产负债表

资产负债表
2006年12月31日

单位：元

	附注	2006年12月31日
资 产		
银行存款	7(1)	198,507,924.90
清算备付金		3,511,759.75
交易保证金		250,000.00
应收利息	7(2)	64,140.03
应收申购款		4,652,251.21
股票投资市值	7(3)	1,412,836,495.27
其中：股票投资成本		1,086,972,574.82
债券投资市值	7(3)	6,660,800.00
其中：债券投资成本		6,710,160.00
权证投资市值		—
其中：权证投资成本		—
待摊费用	7(4)	—
资产总计		1,626,483,371.16
负债及持有人权益		
负债：		
应付证券清算款		8,704,912.34
应付赎回款		57,325,234.74
应付赎回费		962,281.94
应付管理人报酬		1,889,114.51
应付托管费		314,852.42
应付佣金	7(5)	2,041,499.31
其他应付款	7(6)	250,000.00
预提费用	7(7)	130,000.00
负债合计		71,617,895.26
持有人权益：		
实收基金	7(8)	1,233,692,938.28
未实现利得	7(9)	317,824,892.10
未分配收益		3,347,645.52
持有人权益合计		1,554,865,475.90
负债及持有人权益总计		1,626,483,371.16

2、经营业绩表及收益分配表

经营业绩表
2006年9月29日-12月31日

单位：元

项目	附注	2006年9月29日-12月31日
一、收入		104,112,617.35
1、股票差价收入	7(10)	101,024,159.31
2、债券差价收入	7(11)	-
3、权证差价收入	7(12)	991,583.17
4、债券利息收入		12,028.49
5、存款利息收入		1,175,659.62
6、股利收入		464,044.77
7、买入返售证券收入		-
8、其他收入	7(13)	445,141.99
二、费用		6,161,009.83
1、基金管理人报酬		5,167,927.04
2、基金托管费		861,321.14
3、卖出回购证券支出		-
4、其他费用	7(14)	131,761.65
其中：信息披露费		50,000.00
审计费用		80,000.00
三、基金净收益		97,951,607.52
加：未实现利得	7(9)	325,814,560.45
四、基金经营业绩		423,766,167.97

基金收益分配表
2006年9月29日-12月31日

单位：元

项目	附注	2006年9月29日-12月31日
本期基金净收益		97,951,607.52
加：期初基金净收益		-
加：本期损益平准金		669,753.90
可供分配基金净收益		98,621,361.42
减：本期已分配基金净收益	7(15)	95,273,715.90
期末基金净收益		3,347,645.52

3、基金净值变动表

基金净值变动表
2006年9月29日-12月31日

单位：元

项 目	2006年9月29日-12月31日
一、期初基金净值	1,248,974,112.75
二、本期经营活动：	
基金净收益	97,951,607.52
未实现利得	325,814,560.45
经营活动产生的基金净值变动数	423,766,167.97
三、本期基金份额交易：	
基金申购款	333,507,726.36
基金赎回款	-356,108,815.28
基金份额交易产生的基金净值变动数	-22,601,088.92
四、本期向持有人分配收益：	
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-95,273,715.90
五、期末基金净值	1,554,865,475.90

（二）会计报表附注

1、基金简介

国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由国泰基金管理有限公司依照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他有关规定和基金合同发起，经中国证券监督管理委员会《关于同意国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金的批复》（证监基金字[2006]159号文）批准，于2006年9月29日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期为无限期，基金合同生效日（2006年9月29日）的基金份额总额为1,248,974,112.75份基金单位。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行。有关基金设立等文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。

本基金募集情况如下：基金的募集期间为2006年8月28日至2006年9月27日。国泰基金管理有限公司聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金的验资机构。截止2006年9月29日，募集的净销售总额为1,248,741,994.07元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计232,118.68元人民币。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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。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%。

2、本基金年度报告中会计报表的编制遵守基本会计假设。

3、主要会计政策、会计估计及其变更

(1) 会计报表编制基础：

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

(2) 会计期间：本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2006年9月29日(基金合同生效日)至2006年12月31日。

(3) 记账本位币：以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

(4) 记账基础和计价原则：本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

(5) 基金资产的估值原则：

①股票投资：上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

②债券投资：证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

③权证投资：因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出成交日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资按公允价值估值。

④实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

⑤如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 证券投资的成本计价方法：

①股票投资：买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。卖出股票于成交日确认股票差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

②债券投资：买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按附注2(6)③中所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入。出售债券的成本

按移动加权平均法结转。

- ③权证投资：因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

(7) 待摊费用的摊销方法：

在实际受益期间按直线法摊销。

(8) 收入确认和计量：

股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

(9) 费用的确认和计量：

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(10) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

(11) 未实现利得

未实现利得包括因投资估值而产生的未实现估值增值和未实现利得平准金。

未实现利得平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(12) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益。

(13) 基金的收益分配政策：

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，至多六次。全年基金收益分配比例不得低于本基金年度已实现净收益的50%；如当年基金成立未满三个月，则不需分配收益。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

(14) 本报告期重大会计差错的内容和更正金额：无。

4、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。
- (4) 基金买卖股票按照0.1%的税率缴纳股票交易印花税。

5、资产负债表日后事项

基金管理人于2007年1月26日宣告2007年度第一次分红,向截至2007年1月30日止在本基金注册登记人国泰基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人,按每10份基金份额派发红利4.20元。

6、本报告期关联方关系发生变化的情况,本报告期的关联方交易。

(1) 关联方关系发生变化的情况

关联方名称	关联关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
上海国有资产经营有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海爱建信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
浙江省国际信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
上海仪电控股(集团)公司	基金管理人的股东

注:经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准,本基金管理人股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司,2006年1月13日本基金管理人进行了公告,相关工商变更登记已办理完毕。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 关联方交易

①通过关联方席位进行的交易(单位：元)

本报告期末通过关联方席位进行交易。

②关联方报酬

A. 基金管理人报酬

a、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的管理人费

E为前一日的基金资产净值

b、基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

c、在本报告期内，基金应支付基金管理人管理费共5,167,927.04元，其中已支付基金管理人3,278,812.53元，尚余1,889,114.51元未支付。

B. 基金托管费

a、基金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：

$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

b、基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

c、本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共861,321.14元，其中已支付基金托管人546,468.72元，尚余314,852.42元未支付。

C. 与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易（单位：元）

本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易。

D. 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入各关联方投资本基金情况

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为198,507,924.90元。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为1,158,460.15元。

E. 本基金管理人、主要股东及其控制的机构在本报告期内持有本基金情况如下：

	2006年12月31日		
	基金份额	净值	占基金总 份额的比例
中电财务	29,999,825.00	37,799,779.50	2.43%

7、会计报表重要项目说明（单位：元）

(1) 银行存款：

	2006年12月31日
活期存款	198,507,924.90
定期存款	-
合计	<u>198,507,924.90</u>

(2) 应收利息：

	2006年12月31日
应收银行存款利息	50,531.24
应收清算备付金利息	1,580.30
应收债券利息	12,028.49
合计	<u>64,140.03</u>

(3) 投资估值增值按投资类别分别列示如下：

2006年12月31日	成本	市值	估值增值
股票投资	1,086,972,574.82	1,412,836,495.27	325,863,920.45
债券投资	6,710,160.00	6,660,800.00	-49,360.00
权证投资	-	-	-
合计	<u>1,093,682,734.82</u>	<u>1,419,497,295.27</u>	<u>325,814,560.45</u>

(4) 待摊费用：无

(5) 应付佣金：

	2006年12月31日
中国银河证券有限责任公司	1,243,969.00
申银万国证券股份有限公司	258,404.30
中信建投证券有限责任公司	539,126.01
合计	<u>2,041,499.31</u>

(6) 其他应付款：

	2006年12月31日
应付券商席位保证金	250,000.00
合计	<u>250,000.00</u>

(7) 预提费用：

	2006年12月31日
预提审计费用	80,000.00
预提信息披露费	50,000.00
合计	<u>130,000.00</u>

(8) 实收基金：

2006年9月29日	1,248,974,112.75
加：本期因申购的增加数	294,156,889.76
减：本期因赎回的减少数	309,438,064.23
期末数	<u>1,233,692,938.28</u>

(9) 未实现利得：

	投资估值增值	未实现利得平准金	合计
2006年9月29日	-	-	-
本期净变动数	325,814,560.45	-	325,814,560.45
加：本期申购	-	35,017,820.15	35,017,820.15
减：本期赎回	-	43,007,488.50	43,007,488.50
2006年12月31日	<u>325,814,560.45</u>	<u>-7,989,668.35</u>	<u>317,824,892.10</u>

(10) 股票差价收入：

	2006/9/29-2006/12/31
卖出股票成交总额	788,871,323.80
减：卖出股票成本总额	687,183,308.20
应付佣金总额	663,856.29
股票差价收入	<u>101,024,159.31</u>

注：本基金于本报告期末发生因获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价。

(11) 债券差价收入：无

(12) 权证差价收入：

	2006/9/29-2006/12/31
卖出权证成交总额	2,281,423.17
减：卖出权证成本总额	1,289,840.00
权证差价收入	<u>991,583.17</u>

(13) 其他收入：

	2006/9/29-2006/12/31
赎回费收入	445,141.99
合计	<u>445,141.99</u>

(14) 其他费用：

	2006/9/29-2006/12/31
信息披露费	50,000.00
审计费用	80,000.00
银行费用	861.65
开户费	900.00
合计	131,761.65

(15) 本期已分配基金净收益及累计收益分配金额：

	2006/9/29-2006/12/31
第一次收益分配金额	31,362,978.53
第二次收益分配金额	63,910,737.37
累计收益分配金额	95,273,715.90

8、报告期末流通转让受到限制的基金资产

(1) 流通转让受限的股票

①截至2006年12月31日止基金持有的流通转让受限制的股票资产明细如下：
因新股配售或增发而流通受限

	股票名称	配售日期	可流通日	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	备注
1	工商银行	2006-10-23	2007-1-29	8,973,800	27,998,256.00	55,637,560.00	网下申购
2	中国人寿	2006-12-28	2007-4-9	220,500	4,163,040.00	4,163,040.00	网下申购
3	中泰化学	2006-11-28	2007-3-8	103,486	683,007.60	1,120,753.38	网下申购
4	金智科技	2006-11-28	2007-3-8	27,174	385,870.80	604,621.50	网下申购
	合计				33,230,174.40	61,525,974.88	

②估值方法

上述股票为基金网下申购的未上市新股。在编制本报表时，根据有关规定，除中国人寿按成本估值外，其他股票均在2006年12月31日按市场收盘价进行估值。

③流通受限期限及原因

上述股票为基金网下申购的未上市新股。“中国人寿”、“中泰化学”及“金智科技”的受限期限为三个月，“工商银行”已于2007年1月29日上市流通。

(2) 流通转让受限制的债券

截止2006年12月31日本基金未持有流通转让受限的债券。

七、基金投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金资产总值比例
股票	1,412,836,495.27	86.86%
债券	6,660,800.00	0.41%
权证	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	202,019,684.65	12.42%
其他资产	4,966,391.24	0.31%
合 计	1,626,483,371.16	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

行 业	市 值(元)	占净值比例
A农、林、牧、渔业	-	-
B采掘业	115,418,838.33	7.42%
C制造业	474,442,300.27	30.51%
C0食品、饮料	150,950,070.26	9.71%
C4石油、化学、塑胶、塑料	64,104,036.96	4.12%
C6金属、非金属	175,153,485.72	11.26%
C7机械、设备、仪表	64,043,707.33	4.12%
C8医药、生物制品	20,191,000.00	1.30%
D电力、煤气及水的生产和供应业	25,030,280.81	1.61%
E建筑业	-	-
F交通运输、仓储业	60,623,294.55	3.90%
G信息技术业	103,441,491.95	6.65%
H批发和零售贸易	68,507,446.02	4.41%
I金融、保险业	333,037,230.77	21.42%
J房地产业	158,785,451.33	10.21%
K社会服务业	26,810,777.18	1.72%
L传播与文化产业	30,299,774.06	1.95%
M综合类	16,439,610.00	1.06%
合 计	1,412,836,495.27	90.87%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	5,684,413	92,996,996.68	5.98%
2	600028	中国石化	8,978,627	81,885,078.24	5.27%
3	000002	万 科A	5,176,303	79,922,118.32	5.14%
4	600519	贵州茅台	889,475	78,122,589.25	5.02%
5	600016	民生银行	7,621,859	77,742,961.80	5.00%
6	600019	宝钢股份	8,003,136	69,307,157.76	4.46%

7	600030	中信证券	2,295,158	62,841,426.04	4.04%
8	601398	工商银行	8,973,800	55,637,560.00	3.58%
9	600050	中国联通	11,103,573	51,853,685.91	3.33%
10	600000	浦发银行	1,860,875	39,655,246.25	2.55%
11	601006	大秦铁路	4,197,110	33,996,591.00	2.19%
12	600583	海油工程	967,227	33,533,760.09	2.16%
13	000063	中兴通讯	789,508	30,869,762.80	1.99%
14	000024	招商地产	1,026,730	29,138,597.40	1.87%
15	000858	五 粮 液	1,207,351	27,587,970.35	1.77%
16	000069	华侨城A	1,218,118	26,810,777.18	1.72%
17	002024	苏宁电器	589,790	26,776,466.00	1.72%
18	600009	上海机场	1,399,905	26,472,203.55	1.70%
19	000402	金 融 街	1,493,013	25,157,269.05	1.62%
20	600900	长江电力	2,561,953	25,030,280.81	1.61%
21	600809	山西汾酒	762,000	23,614,380.00	1.52%
22	000825	太钢不锈	1,799,606	23,502,854.36	1.51%
23	600628	新世界	2,236,507	23,483,323.50	1.51%
24	600309	烟台万华	948,026	22,970,669.98	1.48%
25	000568	泸州老窖	853,399	21,625,130.66	1.39%
26	600299	星新材料	1,107,658	20,247,988.24	1.30%
27	000623	吉林敖东	610,000	20,191,000.00	1.30%
28	000792	盐湖钾肥	838,906	19,764,625.36	1.27%
29	600037	歌华有线	680,000	16,904,800.00	1.09%
30	600415	小商品城	212,124	16,439,610.00	1.06%
31	000898	鞍钢股份	1,537,454	15,682,030.80	1.01%
32	600585	海螺水泥	494,272	14,828,160.00	0.95%
33	000528	柳 工	800,000	13,680,000.00	0.88%
34	600088	中视传媒	893,594	13,394,974.06	0.86%
35	000157	中联重科	600,000	13,338,000.00	0.86%
36	000039	中集集团	705,226	13,286,457.84	0.85%
37	600694	大商股份	443,978	13,048,513.42	0.84%
38	600660	福耀玻璃	877,234	12,956,746.18	0.83%
39	600383	金地集团	699,890	12,933,967.20	0.83%
40	000060	中金岭南	741,466	12,849,605.78	0.83%
41	600456	宝钛股份	410,983	12,740,473.00	0.82%
42	600685	广船国际	693,734	12,279,091.80	0.79%
43	600048	保利地产	268,548	11,633,499.36	0.75%
44	600761	安徽合力	504,267	11,219,940.75	0.72%
45	600485	中创信测	803,109	10,327,981.74	0.66%
46	000839	中信国安	400,000	9,124,000.00	0.59%
47	600104	上海汽车	974,134	7,958,674.78	0.51%
48	000777	中核科技	600,000	5,568,000.00	0.36%

49	000882	华联股份	753,499	5,199,143.10	0.33%
50	601628	中国人寿	220,500	4,163,040.00	0.27%
51	002092	中泰化学	103,486	1,120,753.38	0.07%
52	002095	网盛科技	12,000	661,440.00	0.04%
53	002090	金智科技	27,174	604,621.50	0.04%
54	601111	中国国航	30,000	154,500.00	0.01%
		合计	99,680,698	1,412,836,495.27	90.87%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额（元）	占期末基金资产净值比例
1	600036	招商银行	124,009,449.04	7.98%
2	600028	中国石化	112,560,005.80	7.24%
3	000002	万科A	99,559,394.66	6.40%
4	600019	宝钢股份	72,845,062.50	4.68%
5	600016	民生银行	70,339,140.21	4.52%
6	600030	中信证券	69,480,629.93	4.47%
7	600519	贵州茅台	64,907,886.41	4.17%
8	601398	工商银行	60,825,192.91	3.91%
9	600050	中国联通	56,767,018.66	3.65%
10	000063	中兴通讯	54,702,415.45	3.52%
11	600900	长江电力	47,755,542.80	3.07%
12	601006	大秦铁路	42,449,554.50	2.73%
13	000898	鞍钢股份	38,564,908.56	2.48%
14	600000	浦发银行	32,430,711.43	2.09%
15	600009	上海机场	32,071,378.98	2.06%
16	600583	海油工程	31,606,160.21	2.03%
17	000069	华侨城A	28,326,673.29	1.82%
18	601588	北辰实业	27,258,062.04	1.75%
19	600685	广船国际	25,862,803.95	1.66%
20	000420	金融街	25,368,260.08	1.63%

2、报告期内累计卖出价值前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额（元）	占期末基金资产净值比例
1	600036	招商银行	64,930,480.81	4.18%
2	000002	万科A	60,127,889.74	3.87%
3	600028	中国石化	58,828,107.16	3.78%
4	601588	北辰实业	35,141,668.50	2.26%
5	601398	工商银行	34,469,492.26	2.22%
6	000898	鞍钢股份	33,204,061.48	2.14%
7	600005	武钢股份	31,425,949.20	2.02%
8	000063	中兴通讯	29,655,383.09	1.91%

9	600900	长江电力	29,397,427.46	1.89%
10	600011	华能国际	25,600,397.62	1.65%
11	600019	宝钢股份	25,583,612.34	1.65%
12	600030	中信证券	24,870,442.48	1.60%
13	600050	中国联通	21,880,855.35	1.41%
14	600016	民生银行	21,873,852.61	1.41%
15	601111	中国国航	18,567,425.97	1.19%
16	600685	广船国际	18,137,766.80	1.17%
17	600519	贵州茅台	17,182,830.07	1.11%
18	600350	山东高速	16,112,880.23	1.04%
19	600219	南山铝业	15,005,488.25	0.97%
20	601006	大秦铁路	14,357,340.25	0.92%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：元

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
1,774,155,883.02	788,871,323.80

（五）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)	占净值比例
1	企业债券	6,660,800.00	0.43%
	合 计	6,660,800.00	0.43%

（六）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	06马钢债	6,660,800.00	0.43%

（七）投资组合报告附注

- 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	250,000.00
应收利息	64,140.03
应收申购款	4,652,251.21
合 计	4,966,391.24

- 4、报告期末基金未持有可转换债券。
- 5、本报告期内投资权证明细如下：
 - a、本报告期内，无因股权分置改革被动持有的权证。
 - b、本报告期内，主动投资的权证

权证代码	权证名称	配售日期	配售数量(份)	成本(元)
580010	马钢CWB1	2006/11/23	1,840,000	1,289,840.00

注：上述权证因持有可分离债而主动持有。

- 6、本报告期内，未投资资产支持证券。

八、基金份额持有人情况

（一）报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数：	27,561
报告期末平均每户持有的基金份额：	44,762.27 份

（二）报告期末基金份额持有人结构

项目	数量（份）	占总份额比例
基金份额总额：		
其中：机构投资者持有的基金份额	179,128,940.81	14.52%
个人投资者持有的基金份额	1,054,563,997.47	85.48%
合 计	1,233,692,938.28	100.00%

九、开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下：

	单位：份
基金合同生效日的基金份额总额	1,248,974,112.75
报告期期初份额总额	1,248,974,112.75
报告期间基金总申购份额	294,156,889.76
报告期间基金总赎回份额	309,438,064.23
报告期期末基金份额总额	1,233,692,938.28

十、重大事件揭示

- （一）报告期内，未召开基金份额持有人大会。

- (二) 基金管理人、基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。
- (三) 报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
- (四) 报告期内，本基金投资策略无变更事项。
- (五) 报告期内，本基金收益分配事项。

2006年12月4日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金第一次分红公告》，以2006年12月1日已实现的可分配收益为基准，向基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利0.25元。

2006年12月9日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金第二次分红公告》，以2006年12月8日已实现的可分配收益为基准，向基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利0.50元。

(六) 报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为80,000.00元，目前的审计机构自本基金成立起一直提供审计服务。

(七) 报告期内，本基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

(八) 报告期内，基金租用证券公司专用席位的有关情况如下：

单位：元

券商名称	席位数量	股票成交金额	比例	债券成交金额	比例
申银万国证券股份有限公司	1	315,127,489.39	12.50%	-	-
中国银河证券有限责任公司	1	1,517,043,100.89	60.17%	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	688,973,063.08	27.33%	-	-
合计	3	2,521,143,653.36	100.00%	-	-

券商名称	权证成交金额	比例	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	258,404.30	12.66%
中国银河证券有限责任公司	2,281,600.00	100.00%	-	-	1,243,969.00	60.93%
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	539,126.01	26.41%
合计	2,281,600.00	100.00%	-	-	2,041,499.31	100.00%

本基金建仓期为六个月，截至报告期末，本基金尚处于建仓期中。

(九) 其他在报告期内发生的重大事件，以及本基金管理人判断为重大事件的事项如下：

1、2006年10月9日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同生效公告》，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2006年9月29日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。

- 2、2006年10月26日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于旗下基金获配中国工商银行股份有限公司首次公开发行A股的公告》，就本基金获配中国银行A股的数量进行了公告。
- 3、2006年11月10日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金开放日常申购公告》，本基金于2006年11月13日起开始办理日常申购交易业务。
- 4、2006年11月22日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金开放日常赎回公告》，本基金于2006年11月27日起开始办理日常赎回交易业务。
- 5、2006年12月6日，本基金管理人于《中国证券报》刊登了《国泰金鹏蓝筹价值基金在中国银行开通“定期定额投资计划”的公告》，就本基金在中国银行开通定期定额业务相关事宜进行了公告。
- 6、2006年12月7日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于董事变更的公告》，经本基金管理人董事会及股东会审议通过，王耀南女士当选为公司董事，周志平先生不再担任公司董事。
- 7、2006年12月14日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于在中国建设银行开通旗下四只开放式基金“定期定额投资计划”的公告》，开通本基金在中国建设银行办理定期定额投资计划。
- 8、2007年1月5日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司关于住所变更的公告》，经公司股东会审议同意，本基金管理人住所变更为上海市浦东新区峨山路91弄98号201A。

十一、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、关于同意国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金募集的批复
- 2、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金合同
- 3、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管协议
- 4、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金年度报告
- 5、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金代销协议
- 6、报告期内披露的各项公告
- 7、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

(二) 存放地点

文件存放地点：本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼。

(三) 查阅方式

投资者查阅方式：投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人国泰基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 33134688, 400-8888-688

客户投诉电话：(021) 23060279

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2007 年 3 月 30 日