

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

(2008 年第二号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

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”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2006 年 8 月 17 日发布的证监基金字[2006]159 号文批准公开发行。本基金的基金合同于 2006 年 9 月 29 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。

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。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《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 2008 年 9 月 29 日，投资组合报告为 2008 年 2 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2008 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

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：上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 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）38561736

股权结构：

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%

（二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 2008 年 9 月 29 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（二期）、国泰金鹏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。2008 年 2 月 18 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 4 月 1 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了社保、年金、专户理财和 QDII 在内的管理业务资格。

（三）主要人员情况

1、董事会：

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，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，总经理助理兼北京分公司总经理，1998年3月起任公司董事、总经理，1999年10月起任公司董事长。

陈良秋，董事，大学本科。1993年7月起在中国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，兼任中投科信科技股份有限公司董事。2007年11月起任公司董事。

刘晶，董事，博士研究生，高级经济师。1997年4月起在中国建设银行总行工作，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。2007年11月起任公司董事。

张和之，董事，硕士研究生、高级会计师。曾任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副总经理、总会计师，现任中国电力财务有限公司副董事长、党组副书记（正局级）、工会主席、纪检组长。2004年2月起任公司董事。

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-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、董事。2006年4月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，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月担任公司总经理。2007年11月起任公司董事、总经理。

龚造成，独立董事，硕士研究生，教授。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，中国人民银行上海分行副行长、行长，国家外汇管理局上海市分局副局长、局长，上海证券交易所常务理事（主持理事会工作），上海证券期货学院院长、教授。2001年5月起任公司独立董事。

曹尔阶，独立董事，大学本科，研究员。长期从事金融证券研究和管理，1979年起历任中国建设银行总行投资研究所副所长、中国建设银行总行投资调查部主任、中国投资咨询公司总经理、中国国际金融公司高级顾问。2001年5月起任公司独立董事。

吴鹏，独立董事，博士研究生。著名律师，执业范围包括金融证券。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。1993 年回国从事律师工作，现为北京中伦金通律师事务所合伙人，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。2001 年 5 月起任公司独立董事。

2、监事会：

万树斌，监事会主席，大学本科，高级会计师。1984 年起在中国建设银行总行工作，历任会计部副处长、计财部副处长、处长、资债部高级经理。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。2007 年 11 月起任公司监事会主席。

李芝樑，监事，硕士研究生。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、经理，投资银行部主任，现任中国电力财务有限公司发展研究中心主任。2004 年 2 月起任公司监事。

黄晓坤，监事，博士研究生，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，万联证券副总裁。2007 年 11 月起任公司监事。

王骏，监事，硕士研究生，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）。2007 年 11 月起任公司职工监事。

安萍，监事，硕士研究生。1999 年 7 月起在上海司法审计事务所、渣打银行上海分行工作。2001 年 1 月加入国泰基金管理有限公司，一直从事稽核监察部内审工作，曾任稽核监察部副总监。现任人力资源部总监。2008 年 9 月起任公司职工监事。

3、高级管理人员：

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

金旭，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

丁昌海，督察长，硕士研究生，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，现任公司督察长。

4、本基金的基金经理：

（1）现任基金经理

黄焱，男，硕士研究生，15 年证券期货基金从业经历。曾任职于中期国际期货公司、和利投资发展公司、平安保险公司投资管理中心。2003 年 1 月加盟国泰基金管理有限公司，2005 年 1 月至 2006 年 7 月任基金金泰的基金经理；2006 年 4 月至 2007 年 4 月任金鹿保本增值基金的基金经理；2006 年 7 月至 2007 年 4 月任金象保本基金的基金经理；2006

年 7 月至 2008 年 4 月担任金龙行业精选基金经理，2007 年 4 月起兼任基金金鑫的基金经理，2008 年 5 月起任国泰金鹏蓝筹价值基金的基金经理。

（2）历任基金经理

2006 年 9 月至 2007 年 3 月由冯天戈担任基金经理，2007 年 3 月至 2008 年 5 月由黄刚担任基金经理。

5、投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员由公司总经理、投资总监、研究开发部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系负责人等人员组成，督察长和运营体系负责人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，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究或相关投资部门提出重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

金旭、余荣权、初伟斌、何江旭、刘夫、梁之平。

丁昌海和巴立康列席投资决策委员会会议。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）基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖 钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理：董杰

托管部门联系人：宁敏

电话：（010）66594977

传真：（010）66594942

发展概况：

中国银行业务涵盖商业银行、投资银行和保险三大领域，其中，商业银行业务是中国银行的传统主营业务，包括公司金融业务、个人金融业务及金融市场业务。中国银行提供的公司金融业务包括存款业务、贷款业务、国际结算及贸易融资业务，以及银行汇票、本票、支票、汇兑、银行承兑汇票、委托收款、托收承付、集中支付、支票圈存及票据托管

等其他公司金融业务；个人金融业务包括储蓄存款业务、个人贷款业务、个人中间业务、“中银理财”服务、私人银行业务和银行卡业务等；金融市场业务主要包括本外币金融工具的自营与代客业务、本外币各类证券或指数投资业务、债务资本市场业务、代客理财和资产管理业务、金融代理及托管业务等。

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，截至 2007 年末底，中国银行境内外机构共有 10,834 家，其中在中国内地拥有 37 家一级分行、直属分行，拥有 283 家二级分行及 9,824 家分支机构；在境外有 689 家分行、子公司及代表处，是中国国际化程度最高的银行。

2007 年，中国银行营业收入快速增长，风险管理水平不断提高，资产质量明显改善，实现税后利润 620.17 亿元人民币，较上年增加 139.59 亿元人民币，增幅 29.05%，其中，股东应享税后利润 562.29 亿元人民币，较上年增加 136.05 亿元人民币，增幅 31.92%；截止 2007 年末，中国银行资本充足率为 13.34%，核心资本充足率为 10.67%；中国银行不良贷款率为 3.12%，较 2006 年末下降 0.92 个百分点。

多年来中国银行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。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，中国银行脱颖而出，成为北京 2008 年奥运会唯一的银行合作伙伴；自 1990 年以来，中国银行一直荣登《财富》500 强排行榜；2004 至 2007 年，中国银行连续被《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”；2007 年，中国银行在《银行家》杂志“世界 1000 家大银行”中排名第 9 位；2007 年中国银行被《金融亚洲》评为“亚洲最佳公司（最佳管理、最佳公司治理、最佳股利政策）”和“中国最佳外汇交易银行”；2007 年中国银行被《亚洲货币》杂志和《贸易融资》杂志分别评为“中国最佳现金管理银行”和“中国最佳贸易融资银行”；在“和讯财经风云榜”中，中国银行被评为“中国银行业杰出服务奖”、“中国银行业理财产品测评最具投资价值奖”；2007 年中国银行再次荣获“优信咨询（Universum）”评选的“最理想雇主奖”。

（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 2003 年 11 月至 2006 年 8 月任中国银行行长助理，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。

董杰先生，自 2007 年 11 月 27 日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。自 2005 年 9 月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员，1983 年 7 月至 2005 年 9 月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于 1962 年 11 月，获得西南财经大学博士学位。

（三）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，现有员工 90 余人；另外，在上海市分行、深圳市分行设有托管业务团队。

（四）证券投资基金托管情况

截止到 2008 年 6 月末，中国银行已托管景宏、同盛、华夏行业精选、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、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、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、海富通股票、海富通精选 2 号、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、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、大成优选、泰达荷银行业精选、国泰沪深 300 指数、国泰金鹏蓝筹价值、友邦华泰盛世中国、友邦华泰积极成长、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、银河竞争优势成长、国投瑞银稳定增利债券型、嘉实研究精选股票、长盛创新先锋灵活配置、国泰金鹿保本二期、易方达中小盘股票型等 57 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、创新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。

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：上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		电话：021-38561727	传真：021-68775881
		客户服务专线：400-888-8688，021-38569000	
		联系人：靖研	网址：www.gtfund.com
2	国泰基金管理有限公司北京理财中心	地址：中国北京市西城区金融大街7号第6层，627-628单元	
		电话：010-66553055	传真：010-66553082
		联系人：魏文	
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：021-38561737	联系人：严仁明

2、代销机构

序号	机构名称	机构信息	
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	联系人：客户服务中心
		客服电话：95566	网址：www.boc.cn
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	
		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	
3	中国农业银行	注册地址：北京市东城区建国门内大街69号	
		法定代表人：项俊波	客户服务电话：95599
		联系人：蒋浩	传真：010-85109219
		网址：www.95599.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：胡怀邦	客服电话：95559
		联系人：曹榕	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
		客户服务热线：95555	网址：www.cmbchina.com
6	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：汤嘉惠、虞谷云	客户服务热线：95528
		网址：www.spdb.com.cn	
7	华夏银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街22号	
		法定代表人：翟鸿祥	客户服务热线：95577
		网址：www.hxb.com.cn	
8	中信银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座	
		法定代表人：孔丹	联系人：李博
		电话：010-65557060	传真：010-65550827
		客服电话：95558	网址：bank.ecitic.com
9	北京银行股份有限公司	注册地址：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	传真：010-66223314
		客服电话：010-96169（北京）022-96269（天津）021-53599688（上海）	
		网址：www.bankofbeijing.com.cn	
10	中国民生银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号	
		法定代表人：董文标	联系人：李群
		电话：010-58351666	传真：010-83914283
		客服电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
11	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址：浦东新区浦东大道981号	
		法定代表人：李秀仑	客户服务电话：021-962999
		网址：www.shrcb.com	
12	中国建银投资证券有限责任公司	注册地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层	
		法定代表人：杨小阳	联系人：刘权
		电话：0755-82026521	客服热线：400-600-8008
		网址：www.cjis.cn	

13	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：021-38676161	传真：021-38670161
		客服电话：400-888-8666	网址： www.gtja.com
14	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：010-62294608-6290	传真：010-62294601
		网址： www.ehongyuan.com	
15	万联证券有限责任 公司	注册地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层	
		法定代表人：李舫金	联系人：李俊
		电话：020-37865026	传真：020-37865030
		客服电话：400-888-8133	网址： www.wlzq.com.cn
16	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：010-85130588	传真：010-65182261
		客服电话：400-888-8108	网址： www.csc108.com
17	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：021-23219000	传真：021-23219100
		客服电话：400-888-8001（全国），021-95553	
		网址： www.htsec.com	
18	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
		网址： www.chinastock.com.cn	
19	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：王勤
		电话：0571-85783715	客服电话：0571-96598
		网址： www.bigsun.com.cn	
20	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：021-54033888	传真：021-54038844
		客服电话：021-962505	网址： www.sw2000.com.cn

21	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
		客服电话：021-962506	网址： www.dfzq.com.cn
22	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
		客服电话：0512-96288	网址： www.dwzq.com.cn
23	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	联系人：肖中梅
		电话：020-87555888	传真：020-87555305
24	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	
25	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：赵明
		电话：010-85252656	传真：010-85252655
		客服电话：0371-67639999	网址： www.msza.com
26	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	联系人：黄枫
		电话：021-62470157	传真：021-62470244
		客服电话：021-962518	
27	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：徐浩明	联系人：刘晨
		电话：021-68816000	传真：021-68815009
		网址： www.ebscn.com	
28	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
		客服电话：0532-96577	网址： www.zxwt.com.cn
29	中信证券股份有限 公司	注册地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦	
		法定代表人：王东明	联系人：陈忠
		电话：010-84588888	传真：010-84865560
		网址： www.ecitic.com	
30	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：张小波
		电话：025-84457777	网址： www.htzq.com.cn
		客服电话：025-84579897	
31	长江证券股份有限 公司	注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦	
		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：400-888-8999	网址： www.cjsc.com
32	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：400-888-8100（全国）、96100（广西）	
		网址： www.ghzq.com.cn	
33	渤海证券股份有限 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：王兆权
		电话：022-28451861	传真：022-28451892
		客服电话：4006515988	网址： www.ewww.com.cn
34	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：400-888-8555，0755-25125666	
		网址： www.lhzq.com	
35	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
36	国信证券股份有限 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
		客服电话：800-810-8868	网址：www.guosen.com.cn
37	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：李玮	联系人：傅咏梅
		电话：0531-81283728	传真：0531-81283735
		客服热线：95538	网址：www.qlzq.com.cn
38	安信证券股份有限 公司	注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元	
		法定代表人：牛冠兴	基金业务联系人：张勤
		联系电话：021-68801217	传真：021-68801119
		公司网址：www.essences.com.cn	
39	东莞证券有限责任 公司	注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼	
		法定代表人：游锦辉	联系人：罗绍辉
		电话：961130	传真：0769-22119423
		网址：www.dgzq.com.cn	
40	恒泰证券有限责任 公司	注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号	
		法定代表人：刘汝军	联系人：常向东
		电话：0471-4913998	传真：0471-4930707
		客服电话：0471-4961259	网址：www.cnht.com.cn
41	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：0755-82943636
		网址：www.newone.com.cn	
42	兴业证券股份有限 公司	客服电话：400-8888111\95565	
		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	

（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：上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		法定代表人：陈勇胜	传真：021-38561800
		联系人：孙艳丽、陆未定	
		客户服务专线：400-888-8688，021-38569000	

（三）出具法律意见书的律师事务所

序号	机构名称	机构信息	
1	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	联系人：安冬
		电话：021-51150298	传真：021-51150398
		经办律师：廖海、吕红	

（四）审计基金财产的会计师事务所

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：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室	
		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：陈宇
		电话：021-61238888	传真：021-61238800
		经办注册会计师：薛竞、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、基金类型

契约型开放式基金

六、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、投资范围

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

（一）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。

（二）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,即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。

(三) 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%×新华巴克莱资本中国债券指数（原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巴克莱资本中国债券指数（原新华雷曼中国债券指数）。

新华雷曼中国债券指数于 2004 年 3 月 15 日正式发布，覆盖了在交易所以及银行间市场上上市的国债、政策性机构债和企业债。作为中国第一个全面的债券指数系列，目前该系列指数已被国内机构投资者广泛使用。新华富时指数有限公司于 2008 年 11 月 7 日宣布其母公司新华财经有限公司与雷曼兄弟公司合作推出的新华雷曼中国债券指数即日起正式更名为新华巴克莱资本中国债券指数。指数的计算和管理并无任何改变。同时，新华富时指数有限公司也将保证对该指数持续和稳定的技术和数据支持。

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基金，同时上述六方从未保证或表示（明示或暗示）使用新华富时蓝筹价值 100 指数或该指数在某日某时的数据可以得到的结果。新华富时指数由新华富时或代表新华富时编制和计算。新华富时将采取一切必要措施以确保指数的精确性。除根据有关法律法规要求或有关协议另有约定外，无论因为疏忽或其他原因，上述六方不因指数的任何错误而对任何人负责，也无义务对任何人和任何错误进行建议。

“FTSE™”是属于伦敦证券交易所和金融时报有限公司共同拥有的商标。“富时指数”是富时国际有限公司的商标。“Xinhua”和“新华”是新华财经有限公司的服务标志和商标。新华富时指数有限公司拥有对以上所有商标的授权使用许可。

新华富时蓝筹价值 100 指数由新华富时指数有限公司编制。关于指数价值和成分股名单的所有版权归属新华富时指数有限公司，基金管理人已然获得完全许可使用此版权创建产品。

十、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。

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。

基金托管人中国银行根据本基金合同规定，于 2008 年 7 月 14 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 2008 年 6 月 30 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

项 目	金 额(元)	占基金资产总值比例
股票	1,844,152,231.40	77.58%
债券	200,218,409.60	8.42%
权证	1,055,658.24	0.04%
银行存款和结算备付金	242,139,630.45	10.19%
其他资产	89,469,720.74	3.76%
合 计	2,377,035,650.43	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	108,828,894.54	4.61%
C 制造业	598,425,521.31	25.33%
C0 食品、饮料	87,273,571.13	3.69%
C3 造纸、印刷	68,771,719.18	2.91%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	42,503,655.57	1.80%
C5 电子	755,983.35	0.03%
C6 金属、非金属	199,902,894.02	8.46%
C7 机械、设备、仪表	133,842,280.21	5.66%
C8 医药、生物制品	65,375,417.85	2.77%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	117,762,222.90	4.98%
E 建筑业	37,662,621.36	1.59%
F 交通运输、仓储业	58,862,381.44	2.49%
G 信息技术业	129,207,442.60	5.47%
H 批发和零售贸易	144,712,080.72	6.12%
I 金融、保险业	462,339,015.05	19.57%
J 房地产业	169,899,912.52	7.19%
K 社会服务业	5,675,981.76	0.24%
L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	10,776,157.20	0.46%
合 计	1,844,152,231.40	78.05%

（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	600036	招商银行	4,432,116	103,800,156.72	4.39%
2	601166	兴业银行	2,835,675	72,224,642.25	3.06%
3	600900	长江电力	4,599,666	67,385,106.90	2.85%

4	601318	中国平安	1,173,666	57,814,787.16	2.45%
5	600000	浦发银行	2,432,058	53,505,276.00	2.26%
6	601628	中国人寿	2,136,739	51,110,796.88	2.16%
7	000002	万科 A	5,634,968	50,771,061.68	2.15%
8	600030	中信证券	2,100,000	50,232,000.00	2.13%
9	601001	大同煤业	2,053,430	43,409,510.20	1.84%
10	600100	同方股份	2,284,355	41,415,356.15	1.75%

（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)	占净值比例
1	金融债券	100,000,000.00	4.23%
2	央行票据	96,080,000.00	4.07%
3	企业债券	4,138,409.60	0.18%
	合 计	200,218,409.60	8.47%

（五）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	07 农发 12	100,000,000.00	4.23%
2	08 央行票据 28	96,080,000.00	4.07%
3	08 宝钢债	4,138,409.60	0.18%

（六）投资组合报告附注

1、本报告期内本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、本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	1,804,697.81
应收证券清算款	82,465,629.36
应收利息	4,307,122.93
应收股利	441,871.62
应收申购款	450,399.02
合 计	89,469,720.74

4、本报告期末本基金未持有可转换债券。

5、本报告期末本基金持有的权证明细如下：

序号	权证名称	代码	数量(份)	市值(元)	市值占基金净资产比例	获得方式
1	宝钢 CWB1	580024	881,920	1,055,658.24	0.04%	被动持有
合计			881,920	1,055,658.24	0.04%	

6、本报告期内本基金未投资资产支持证券。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2008 年 6 月 30 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
2006 年 9 月 29 日至 2006 年 12 月 31 日	34.59%	1.13%	56.28%	1.53%	-21.69%	-0.40%
2007 年度	105.22%	1.88%	70.10%	1.39%	35.12%	0.49%
2008 年上半年	-37.16%	2.39%	-30.75%	1.85%	-6.41%	0.54%
2006 年 9 月 29 日至 2008 年 6 月 30 日	73.56%	1.97%	56.34%	1.50%	17.22%	0.47%

十三、基金费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、席位费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 7、基金的资金汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的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的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本部分第（一）条 1 款至 2 款费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2008年5月13日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期；

- 2、更新了“第三部分 基金管理人”的“基金管理人管理基金的基本情况”、“主要人员情况”等内容；
- 3、更新了“第四部分 基金托管人”的相关信息；
- 4、更新了“第五部分 相关服务机构”的相关信息，增加上海农村商业银行股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司为本基金的代销机构；
- 5、更新了“第九部分 基金的投资”中基金投资组合报告为本基金2008年二季度报告的内容；
- 6、更新了“第十部分 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；
- 7、更新了“第十二部分 基金资产的估值”，增加了“估值的基本原则”；
- 8、更新了“第二十一部分 对基金份额持有人的服务”中基金管理人的联系方式等内容；
- 9、更新了“第二十二部分 其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站 www.gtfund.com。

国泰基金管理有限公司

二〇〇八年十一月十二日