国泰沪深300指数证券投资基金

更新招募说明书摘要

（2010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

截止日：二○一○年五月十一日

重要提示

本基金由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而成。国泰金象保本增值混合证券投资基金根据中国证监会《关于同意国泰金象保本增值混合证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2004]140号）和《关于国泰金象保本增值混合证券投资基金募集时间的确认函》（基金部函[2004]109号）的核准募集。《国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同》于2004年11月10日正式生效。

根据《国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同》的规定，经基金份额持有人大会表决通过，并经中国证监会核准（证监基金字[2007]307号），本基金管理人对《国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同》进行了修改，国泰金象保本增值混合证券投资基金在保本期满后转型为国泰沪深300指数证券投资基金。

自2007年11月11日起，《国泰沪深300指数证券投资基金基金合同》生效，《国泰金象保本增值混合证券投资基金基金合同》自该日起失效。

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，投资者申购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，基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。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。基金投资者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。基金投资者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2010年5月11日，投资组合报告为2010年1季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2009年12月31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
住所：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：何晔
联系电话：（021）38561743
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2010年5月11日，本基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金，以及14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（由金鼎证券投资基金转型而来）、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）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金、国泰纳斯达克100指数证券投资基金。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多个投资组合。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24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3月24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，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

（三）主要人员情况

1、董事会成员：

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，18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年起任国泰证券有限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董事、总经理，1999年10月起任公司董事长、党委书记。

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月起在中国建投工作，任企业管部部总经理助理、副总经理、投资部负责人，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。

梁凤玉，董事，硕士研究生，高级会计师。1994年8月至2006年7月，在中国建设银行辽宁省分行工作，历任葫芦岛分行房贷部副主任、城内支行副行长、葫芦岛分行国际业务部副主任、计划财务部副主任；辽宁省分行计划财务部副主任科员、四级财务分析师。2006年7月起在中国建投工作，其间曾任中国投资咨询公司财务总监。现任中国建投财务会计部计划财务一处副高级经理。2009年12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，国家电力公司中兴实业发展总公司副总经理、总会计师、副董事长、中国电力财务有限公司副董事长、党组副书记（正局级）、正局级调研员。2004年2月起任公司董事。

王耀南，董事，大专，17年证券从业经历。1993年至1997年任职广州珠江信托投资公司证券部。1997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、董事、党总支书记。2006年4月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，17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。2007年11月起任公司董事、党委副书记。

龚浩成，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等。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、监事会成员：

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月起任中国建投财会部副总经理，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，发展研究中心主任兼董事会办公室常务副主任。现任中国电力财务有限公司董事会办公室主任。2004年2月起任公司监事。

黄晓坤，监事，博士研究生，经济师。8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任研究员。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，从事基金登记核算工作，现任运营管理部总监。2007年11月起任公司职工监事。

张晖，监事，硕士研究生。1991年7月至1994年10月，在江苏省扬州市外贸公司进口部工作。1994年10月至2000年3月，在招商银行深圳管理部工作，任文档室主任。2001年2月至2009年8月，在宝盈基金工作，任总经理助理、董事会秘书。2009年8月加入国泰基金，任总经理助理和职工监事。

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。

巴立康，硕士研究生，高级会计师，17年证券从业经历。1993年4月至1998年4月在华夏证券工作，历任营业部财务经理、公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理。1998年4月至2007年11月在华夏基金管理有限公司工作，历任综合管理部总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。现任公司副总经理。

初伟斌，硕士研究生，16年证券从业经历。1992年8月至1996年5月在中国注册会计师协会工作，1996年5月至2003年9月在中国证监会任基金监管部副处长，2003年9月至2008年6月在景顺长城基金管理有限公司工作，历任法律监察稽核总监、副总经理。现任公司副总经理。

李峰，硕士研究生，14年银行证券基金从业经历。曾任荷兰商业银行上海分行中国区监察主管，国联安基金管理有限公司监察稽核专员，信诚基金管理有限公司督察长，美国雷曼兄弟亚洲投资有限公司上海代表处中国区合规总监。2009年2月加盟国泰基金管理有限公司，现任公司督察长。

梁之平，本科，13年证券从业经历。曾任国泰君安证券股份有限公司国际业务部研究部经理，大成基金管理有限公司基金运营部总监、市场部总监兼客户服务中心总监、委托投资部总监，2008年3月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理兼财富管理中心总经理，现任公司副总经理。

4、本基金基金经理及相关研究人员配备

（1）现任基金经理

刘翔，男，工商管理硕士，5年证券基金从业经验。曾就职于中国海员对外技术服务公司深圳分公司、Sprint AAA公司、美国通用电气公司、深圳中兴通讯股份有限公司，2005年8月至2007年7月在标准普尔信息服务公司任资深分析师，2007年7月至2007年12月在招商基金管理有限公司任高级信用分析师。2007年12月加盟国泰基金管理有限公司，任高级策略分析师。2009年3月12日起担任国泰沪深300指数基金的基金经理，2010年4月29日起兼任国泰纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。

（2）历任基金经理

自本基金成立至2009年3月31日，由黄刚担任本基金的基金经理。

（3）相关研究人员配备情况

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数量分析的金融工程师和基本面分析研究员协助基金经理的投资管理工作。金融工程部负责数量化分析，根据标的指数的变化等因素提出投资组合管理建议，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提出研究分析报告。

5、投资决策委员会

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司总经理、分管副总经理、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、市场体系等负责人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同，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，以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

余荣权先生：拟任副总经理
归江先生：投资总监
初伟斌先生：副总经理
梁之平先生：副总经理兼财富管理中心总经理
刘夫先生：固定收益类资产投资副总监兼财富管理中心投资总监
张则斌先生：财富管理中心投资副总监
黄焱先生：基金管理部副总监

6、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：唐州徽
电话：（010）66594855
传真：（010）66594942
发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后行使中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务大众、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，中国银行成为国家外汇外贸专业银行，为国家对外经贸发展和国内经济建设作出了重大贡献。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行开始股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为首家在内地和香港发行上市的中国商业银行。中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港、澳门及29个国家为客户提供全面的金融服务。主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资附属机构中银国际控股集团开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险有限公司及其附属和联营公司经营保险业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过全资子公司中银集团投资有限公司从事直接投资和投资管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。按核心资本计算，2009年中国银行在英国《银行家》杂志"世界1000家大银行"排名中列第十一位。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神，稳健经营的理念，客户至上的宗旨和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象，中国银行被The Banker（英国《银行家》）评为"2009年中国年度银行"，被Euromoney（《欧洲货币》）评为"2009年度最佳私人银行"，被Global Finance（《环球金融》）评为"2009年度中国最佳外汇交易银行"，被Trade Finance（《贸易金融》）评选为"中国本土最佳贸易服务银行"，被The Asset（《财资》）评为"中国最佳贸易融资银行"，被Finance Asia（《金融亚洲》）评为"中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行、中国最佳外汇交易银行"。面对新的历史机遇，中国银行将坚持可持续发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（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副总经理、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。

李早航先生，自2004年8月起任中国银行股份有限公司本行执行董事。2000年11月加入中国银行并自此担任中国银行副行长。于1980年11月至2000年11月任职于中国建设银行，曾工作于多个岗位，先后担任分行行长、总行多个部门的总经理及副行长。1978年毕业于南京信息工程大学。2002年6月起担任中银香港控股非执行董事。

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，下设覆盖销售集合类产品、机构类产品、全球托管产品、市场、运营、投资分析及监督服务、风险管理与内控合规、核算估值、信息技术、资金和证券清算交收等各层面的多个团队，现有员工90110余人。另外，中国银行在广东省分行、北京市分行、上海市分行、深圳市分行、广东省分行、江苏省分行设有托管业务团队。

（四）证券投资基金托管情况

截止到20107年11312月末月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合（二期）、国泰金鹏蓝筹混合、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、金鹰成份优选股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、万家180指数、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、宝盈核心优势混合、国富成长动力股票、泰信蓝筹精选股票、华泰柏瑞货币、国泰区位优势股票、招商行业领先股票、东方核心动力股票、金鹰行业优势股票、泰信债券增强收益、万家稳健增利债券、嘉实回报混合、海富通中证100指数（LOF）、易方达深证100ETF联接、摩根士丹利华鑫强收益债券型、工银全球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）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、国泰金鹿保本增值混合、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、嘉实研究精选股票型、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、友邦华泰价值、工银瑞信大盘蓝筹、银华领先策略股票型、泰达荷银集利债券型基金、华宝兴业大盘精选股票型基金、华夏策略精选灵活配置混合型基金、富兰克林国海强化收益债券型等64781只证券投资基金，等52只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场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直销柜台	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：021-38561759	传真：021-38561750
		客户服务专线：400-888-8688，021-38569000	
		联系人：蔡丽萍	网址：www.gtfund.com
2	国泰基金管理有限公司北京直销柜台	地址：中国北京市西城区金融大街7号第5层	
		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：021-38561735	联系人：杨荣华

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	中国农业银行股份有限公司	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	客户服务电话：95599
		联系人：蒋浩	传真：010-85109219
		网址：www.95599.cn	
4	中国工商银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100005）	
		办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100005）	
		法定代表人：姜建清	电话：95588
		网址：www.icbc.com.cn	
5	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	
6	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：丰靖
		电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
		客户服务热线：95555	网址：www.cmbchina.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：汤嘉惠、虞谷云	客户服务热线：95528
		网址：www.spdb.com.cn	
8	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	
		办公地址：北京市东城区建国门内大街22号	
		法定代表人：吴建	客服服务热线：95577
		网址：www.hxb.com.cn	
9	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
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：董云巍、吴海鹏
		电话：010-58351666	传真：010-83914283
		客服电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
11	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：王曦
		电话：010-66223584	传真：010-66226073
		客服电话：010-96169	
		网址：www.bankofbeijing.com.cn	
12	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	
		法定代表人：刘安东	联系人：陈春林
		客服电话：95580	网址：www.psbc.com
13	中国建银投资证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层	
		法定代表人：杨明辉	联系人：刘权
		电话：0755-82026521	客服电话：400-600-8008
		网址：www.cjis.cn	
14	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
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：冯戎	联系人：李茂俊
		电话：010-62294608	传真：010-62296854
		客服电话：400-800-0562	网址：www.hysec.com
16	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：张建军	联系人：罗创斌
		电话：020-37865017	传真：020-37865030
		客服电话：400-888-8133	网址：www.wlzq.com.cn
17	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
18	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：李笑鸣
		电话：021-23219000	传真：021-23219100
		客服电话：400-888-8001（全国），021-95553	
		网址：www.htsec.com	
19	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：顾伟国	联系人：李洋
		电话：010-66568047	传真：010-66568536
		网址：www.chinastock.com.cn	
20	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：俞会亮
		电话：0571-85776115	客服电话：0571-96598
		网址：www.bigsun.com.cn	
21	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
22	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：95503	网址：www.dfzq.com.cn
23	东吴证券有限责任公司	注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦	
		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：0512-33396288	网址：www.dwzq.com.cn
24	广发证券股份有限公司	注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼	
		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：黄岚
		电话：020-87555888	传真：020-87555305
		客服电话：95575	网址：www.gf.com.cn
25	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：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼	
		法定代表人：管荣升	联系人：徐美云
		电话：0791-6285337	传真：0791-6288690
		网址：www.gsstock.com	
26	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：400-619-8888	网址：www.mszq.com
27	上海证券有限责任公司	注册地址：上海市西藏中路336号	
		法定代表人：蒋元真	联系人：王伟力
		电话：021-53519888	传真：021-62470244
		客服电话：021-962518	网址：www.962518.com
28	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闸路1508号	
		法定代表人：徐浩明	联系人：刘晨
		电话：021-22169999	传真：021-22169134
		客服电话：10108998、400-888-8788	
		网址：www.ebscn.com	
29	中信万通证券有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层1507-1510	
		办公地址：青岛市东海西路28号	
		法定代表人：史洁民	联系人：刘光明
		电话：0532-85022273	传真：0532-85022605
		客服电话：0532-96577	网址：www.zxwt.com.cn
30	中信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层	
		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	
31	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：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：95597	
32	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
		客服电话：400-888-8999、027-85808318	
		网址：www.95579.com	
33	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：武斌
		电话：0755-83707413	传真：0755-83700205
		客服电话：400-888-8100（全国），96100（广西）	
		网址：www.ghzq.com.cn	
34	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：王春峰	联系人：王兆权
		电话：022-28451861	传真：022-28451892
		客服电话：400-651-5988	网址：www.ewww.com.cn
35	华泰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或95513	
		网址：www.lhzq.com	
36	中原证券股份有限公司	注册地址：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦	
		办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号17层	
		法定代表人：石保上	联系人：程月艳、耿铭
		电话：0371-65585670	传真：0371-65585665
		客服电话：400-813-96660371-967218	
		网址：www.ccnew.com	
37	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：齐晓燕
		电话：0755-82130833	传真：0755-82133302
		客服电话：95536	网址：www.guosen.com.cn
38	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	
		客服电话：400-888-8111\95565	
39	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：谢高得
		电话：021-38565785	传真：021-38565783
		客服电话：400-888-8123	网址：www.xyzq.com.cn
40	齐鲁证券有限公司	注册地址：山东省济南市经十路20518号	
		办公地址：山东省济南市经十路20518号	
		法定代表人：李玮	联系人：傅咏梅
		电话：0531-81283728	传真：0531-81283735
		客服电话：95538	网址：www.qlzq.com.cn
41	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	联系人：张勤
		联系电话：021-68801217	传真：021-68801119
		客服电话：400-800-1001	
		网址：www.essence.com.cn	
42	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：梁健伟
		电话：0796-22100159	传真：0769-22119423
		客服电话：0769-961130	网址：www.dgzq.com.cn
43	恒泰证券股份有限公司	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
44	厦门证券有限公司	注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼	
		法定代表人：傅毅辉	联系人：叶朝辉
		电话：0592-5161816	传真：0592-5161102
		客服电话：0592-5163588	网址：www.xmzq.cn
45	华宝证券有限责任公司	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层	
		法定代表人：陈林	联系人：刘闻川
		电话：021-50122222	传真：021-50122200
		客服电话：021-38929908	网址：www.cnhbstock.com
46	英大证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层	
		法定代表人：赵文安	联系人：王睿
		电话：0755-83007069	传真：0755-83007167
		客服电话：0755-26982993	网址：www.ydsc.com.cn
47	中国国际金融有限公司	注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层	
		法定代表人：李剑阁	联系人：邓力伟
		电话：010-65051166	传真：010-65051156
		网址：www.cicc.com.cn	
48	广发华福证券有限责任公司	注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层	
		法定代表人：黄金琳	联系人：张腾
		电话：0591-87278701	传真：0591-87841150
		客服电话：0591-96326	网址：www.gfhfzq.com.cn
49	天相投资顾问有限公司	注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701	
		法定代表人：林义相	联系人：莫晓丽
		电话：010-66045566	传真：010-66045500
		客服电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
50	信达证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层	
		法定代表人：张志刚	联系人：唐静
		电话：010-88656100	传真：010-88656290
		客服电话：400-800-8899	网址：www.cindasc.com
51	中国民族证券有限责任公司	注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层	
		法定代表人：赵大建	联系人：姜建平
		电话：010-59355543	传真：010-66553791
		客服电话：400-889-5618	网址：www.e5618.com
52	华龙证券有限责任公司	注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号	
		法定代表人：李晓安	联系人：李昕田
		电话：0931-8888088	传真：0931-4890515
		客服电话：0931-4890100、4890619、4890618	
		网址：www.hlzqgs.com	
53	国元证券股份有限公司	注册地址：安徽省合肥市寿春路179号	
		法定代表人：凤良志	联系人：李飞
		电话：0551-2207323	传真：0551-2207322
		客服电话：95578	网址：www.gyzq.com.cn
54	杭州银行股份有限公司	注册地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦	
		法定代表人：马时雍	联系人：严峻
		电话：0571-85163127	传真：0571-85179591
		客服电话：400-888-8508	
		网址：www.hzbank.com.cn	
55	渤海银行股份有限公司	注册地址：天津市河西区马场道201-205号	
		法定代表人：刘宝凤	联系人：王宏
		电话：022-58316666	传真：022-58316259
		客服电话：400-888-8811	网址：www.cbhb.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：何晔	
		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：廖海
		电话：021-51150298	传真：021-51150398
		经办律师：廖海、吕红	

（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

国泰沪深300指数证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式，股票型指数基金

六、投资目标

本基金运用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数量化风险控制手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差不超过0.35%，实现对沪深300指数的有效跟踪。

七、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）等，股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%，其中备选成份股投资比例不高于15%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。

本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，在履行适当程序后，本基金可以将其纳入投资范围。

八、投资理念

本基金采取被动式指数化投资管理方式，实现与市场的同步增长，获取中国经济增长的长期稳定回报。

九、投资策略

本基金为以完全复制为目标的指数基金，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

十、业绩比较基准

业绩基准=90%×沪深300指数收益率+10%×银行同业存款收益率

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所共同开发的中国A股市场指数，它是中国第一支由权威机构编制、发布的全市场指数，流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况，其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用，能够作为指数基金的跟踪标的。

如果基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的跟踪目标和投资对象，并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的精确性。但无论因为疏忽或其他原因，中证指数有限公司，上海证券交易所，深圳证券交易所不因指数的任何错误对任何人负责，也无义务对任何人和任何错误给予建议。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

十一、风险收益特征

本基金属于中高风险的证券投资基金品种。

十二、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2010年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截止2010年3月31日。本报告中财务资料未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,561,690,034.56	91.71
	其中：股票	6,561,690,034.56	91.71
2	固定收益投资	207,631,745.60	2.90
	其中：债券	207,631,745.60	2.90
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	367,412,762.46	5.14
6	其他资产	18,048,260.52	0.25
7	合计	7,154,782,803.14	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

2、指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	27,478,144.18	0.39
B	采掘业	734,510,288.29	10.31
C	制造业	1,950,531,706.06	27.37
C0	食品、饮料	257,451,729.10	3.61
C1	纺织、服装、皮毛	39,682,167.26	0.56
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	17,868,538.45	0.25
C4	石油、化学、塑胶、塑料	167,434,923.83	2.35
C5	电子	28,336,873.68	0.40
C6	金属、非金属	554,337,398.41	7.78
C7	机械、设备、仪表	636,650,034.20	8.93
C8	医药、生物制品	216,917,742.07	3.04
C99	其他制造业	31,852,299.06	0.45
D	电力、煤气及水的生产和供应业	213,915,054.25	3.00
E	建筑业	195,331,008.85	2.74
F	交通运输、仓储业	331,546,246.81	4.65
G	信息技术业	223,862,564.44	3.14
H	批发和零售贸易	206,147,173.93	2.89
I	金融、保险业	2,043,048,092.01	28.67
J	房地产业	403,664,894.70	5.66
K	社会服务业	80,135,624.58	1.12
L	传播与文化产业	19,982,182.19	0.28
M	综合类	131,537,054.27	1.85
	合计	6,561,690,034.56	92.08

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名指数投资明细和前五名积极投资明细

1、指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	15,041,912	244,882,327.36	3.44
2	601328	交通银行	22,061,106	182,665,957.68	2.56
3	601318	中国平安	3,563,464	179,598,585.60	2.52
4	600016	民生银行	23,256,951	178,845,953.19	2.51
5	600030	中信证券	5,668,194	161,090,073.48	2.26
6	601166	兴业银行	4,281,076	158,057,325.92	2.22
7	600000	浦发银行	6,520,443	148,535,691.54	2.08
8	601088	中国神华	4,055,843	117,213,862.70	1.64
9	000002	万 科 A	11,827,799	112,364,090.50	1.58
10	601601	中国太保	3,853,826	104,053,302.00	1.46

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	207,631,745.60	2.91
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	–	–
7	其他	–	–
8	合计	207,631,745.60	2.91

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010004	20国债(4)	2,070,520	207,631,745.60	2.91

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（八）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、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	980,271.16
2	应收证券清算款	8,006,900.02
3	应收股利	–
4	应收利息	5,159,269.06
5	应收申购款	3,901,820.28
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	18,048,260.52

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

6、报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

十三、基金的业绩

基金业绩截止日为2009年12月31日。

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
2007年11月11日至2007年12月31日	0.41%	0.09%	5.38%	1.75%	-4.97%	-1.66%
2008年度	-62.61%	2.78%	-61.64%	2.73%	-0.97%	0.05%
2009年度	89.60%	1.93%	84.85%	1.85%	4.75%	0.08%
2007年11月11日至2009年12月31日	-28.82%	2.33%	-25.27%	2.32%	-3.55%	0.01%

十四、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、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、基金的指数使用费；
9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（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0.5%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0.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.5%÷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首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.10%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0.10%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%÷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首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第3至第9项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）基金管理费和基金托管费的调整

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。基金管理人必须最迟于新的费率实施前2日依照有关规定在指定媒体上公告。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十五、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2009年12月25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"第三节 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"第四节 基金托管人"的"基金托管人基本情况"等相关信息；
4、更新了"第五节 相关服务机构"的相关信息，增加广发华福证券责任有限公司、天相投资顾问有限公司等为本基金的代销机构；
5、更新了"第十节 基金的投资"中基金投资组合报告为本基金2010年1季度报告的内容；
6、更新了"第十一节 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"第二十二节 对基金份额持有人的服务"中的相关内容；
8、更新了"第二十三节 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○一○年六月二十三日