

# 盈富 基金

**盈富基金**  
Tracker Fund of Hong Kong

SSGA<sup>®</sup>

STATE STREET  
GLOBAL ADVISORS

二零零二年年報

二零零二年一月一日至二零零二年十二月三十一日

# 目 錄

經理人及信託人之責任聲明	1
致盈富基金單位持有人之信託人報告	2
致盈富基金信託人之核數師報告	3
營運報表	4 – 5
資產負債表	6
資本賬變動表	7
現金流量表	8
分派報表	9
財務報表附註	10 – 15
投資組合	16 – 17
投資組合變動表	18
行政及管理	19
業績紀錄	20

## 經理人及信託人之責任聲明

### 經理人之責任

根據香港證券及期貨事務監察委員會制定之單位信託及互惠基金守則(以下簡稱「證監會守則」)，以及於一九九九年十月二十三日訂立之信託契據之規定(以下簡稱「信託契據」)，盈富基金之經理人必須就每個會計年度期間編製足以真實及公平地反映盈富基金於該期間終結時之財務狀況及截至該日止期間之交易情況之財務報表。在編製該等財務報表時，經理人必須：

- 選擇適當之會計政策，並且貫徹應用該等會計政策；
- 作出審慎及合理之判斷和估計；及
- 按照盈富基金將會持續經營為基準(如此項假設不合適則除外)，編製財務報表。

經理人亦須根據「信託契據」管理盈富基金，並採取合理步驟預防及查察任何欺詐及其他違規行為。

### 信託人之責任

盈富基金之信託人必須：

- 確保盈富基金由經理人按照「信託契據」管理，以及盈富基金之投資及借貸權力符合有關規定；
- 確保有足夠之會計及其他紀錄；
- 保障盈富基金之財產及其附帶權利；及
- 於每個會計年度期間向基金單位持有人匯報經理人在管理盈富基金方面之操守。

### 致盈富基金單位持有人之信託人報告

吾等謹此確認，吾等認為截至二零零二年十二月三十一日止年度，盈富基金經理人在各重大方面均按照「信託契據」之條款管理盈富基金。

根據「證監會守則」第**8.6(1)**條，信託人必須提供在有關期間內，該基金的表現與有關指數的實際表現的比較。於本年度內，恆生指數下跌 **18.21%**，而同期盈富基金每基金單位資產淨值下跌 **18.08%**。

美國道富銀行

二零零三年三月二十八日

## 致盈富基金信託人之核數師報告

本核數師已完成審核第四至第十五頁之財務報表，該等財務報表乃按照一九九九年十月二十三日訂立之信託契據之有關條款、香港證券及期貨事務監察委員會制定之單位信託及互惠基金守則，以及香港普遍採納之會計原則編製。

### 經理人及核數師各自之責任

編製真實兼公平之財務報表乃盈富基金經理人之責任。在編製該等真實兼公平之財務報表時，經理人必須採用適當之會計政策，並且貫徹應用該等會計政策。

本核數師之責任是根據審核之結果，對該等財務報表作出獨立意見，並向基金信託人報告。

### 意見之基礎

本核數師已按照香港會計師公會所頒佈之核數準則進行審核工作。審核範圍包括以抽查方式查核與財務報表所載數額及披露事項有關之憑證，亦包括評審經理人於編製財務報表時所作之重大估計和判斷，所採用之會計政策是否適合盈富基金之具體情況，及有否貫徹應用並足夠披露該等會計政策。

本核數師在策劃和進行審核工作時，均以取得所有本核數師認為必需之資料及解釋為目標，以便獲得充分憑證，就該等財務報表是否存有重大錯誤陳述，作出合理之確定。在作出意見時，本核數師亦已評估該等財務報表所載之資料在整體上是否足夠。本核數師相信我們之審核工作已為下列意見提供合理之基礎。

### 意見

本核數師認為，盈富基金之財務報表乃按照一九九九年十月二十三日訂立之信託契據之有關披露條款，以及香港證券及期貨事務監察委員會制定之單位信託及互惠基金守則妥為編製，並足以真實兼公平地顯示盈富基金於二零零二年十二月三十一日結算時之財務狀況，及截至二零零二年十二月三十一日止年度之盈利及現金流量。

### 羅兵咸永道會計師事務所

香港執業會計師

香港，二零零三年三月二十八日

營運報表

截至二零零二年十二月三十一日止年度

	附註	二零零二年 一月一日至 二零零二年 十二月三十一日 港元	二零零一年 一月一日至 二零零一年 十二月三十一日 港元
收入			
股息		899,587,830	798,796,960
交易費	3(a)	9,660,000	17,381,976
銀行利息	7(c)	2,931,438	6,601,814
其他收入	3(b)	9,914,953	10,404,617
		<u>922,094,221</u>	<u>833,185,367</u>
海外預扣稅項	5	(37,297,678)	(32,878,173)
		<u>884,796,543</u>	<u>800,307,194</u>
開支			
經理人費	7(a)	(12,491,381)	(12,833,996)
信託人費	7(b)	(12,491,381)	(12,833,996)
兌換代理人費	8(b)	(4,084,000)	(7,207,564)
指數特許權費	8(c)	(4,079,842)	(4,357,976)
過戶處費用	8(a)	(3,216,893)	(3,750,315)
銀行手續費		(1,033,240)	(1,770,851)
出版及印刷費用		(2,796,128)	(3,471,238)
法律及其他專業費用		(483,090)	(703,685)
攤銷開辦費用		(542,500)	(542,500)
核數費		(100,000)	(100,000)
其他經營開支		(1,073,211)	(2,557,328)
		<u>(42,391,666)</u>	<u>(50,129,449)</u>
已發行基金單位之等值股息金額		242,356,133	284,203,945
已贖回基金單位之等值股息金額		(206,141,989)	(205,450,184)
		<u>(6,177,522)</u>	<u>28,624,312</u>
可供分派之收入淨額		878,619,021	828,931,506
轉撥至分派報表之數額		(878,619,021)	(828,931,506)
		<u>—</u>	<u>—</u>

第十至十五頁之附註為財務報表之一部分。

## 營運報表(續)

截至二零零二年十二月三十一日止年度

	二零零二年 一月一日至 二零零二年 十二月三十一日 港元	二零零一年 一月一日至 二零零一年 十二月三十一日 港元
投資虧損淨額		
出售投資之已變現虧損	(5,946,759,814)	(5,297,382,097)
重估投資之未變現收益/虧損變動淨額	959,892,306	(2,517,475,773)
	<u>(4,986,867,508)</u>	<u>(7,814,857,870)</u>
年虧損淨額(不包括轉撥至分派報表之數額)	(4,986,867,508)	(7,814,857,870)
轉撥自資本賬之數額	4,986,867,508	7,814,857,870
	<u>—</u>	<u>—</u>

第十至十五頁之附註為財務報表之一部分。

**資產負債表**

於二零零二年十二月三十一日

	附註	二零零二年 十二月三十一日 港元	二零零一年 十二月三十一日 港元
<b>資產</b>			
投資		23,586,688,605	27,633,677,574
開辦費用		1,010,888	1,553,388
應收股息		3,390,091	2,851,133
其他應收賬款及預付款項		85,139	32,366
經紀欠款		1,211,299	11,271,680
銀行結存	7(c)	93,868,634	67,506,674
資產總值		<u>23,686,254,656</u>	<u>27,716,892,815</u>
<b>負債</b>			
應付信託人費		3,129,033	3,188,087
應付經理人費		3,129,033	3,188,087
應付指數特許權費		979,997	999,682
應付過戶處費用		261,100	274,500
其他應付賬款及應計項目		1,387,043	1,482,310
欠經紀款項		1,179,089	11,385,740
贖回基金單位之應付賬款		1,052,241	—
負債總值		<u>11,117,536</u>	<u>20,518,406</u>
資產淨值		<u>23,675,137,120</u>	<u>27,696,374,409</u>
<b>資金來源：</b>			
資本賬		<u>23,675,137,120</u>	<u>27,696,374,409</u>
已發行基金單位	4	<u>2,522,992,500</u>	<u>2,417,992,500</u>
每基金單位資產淨值		<u>9.38</u>	<u>11.45</u>
每新增基金單位資產淨值(1個新增基金單位相等於 1,000,000個基金單位)		<u>9,383,752</u>	<u>11,454,285</u>

於二零零三年三月二十八日由信託人及經理人通過

**美國道富銀行**
**道富環球投資管理亞洲有限公司**

第十至十五頁之附註為財務報表之一部分。



資本賬變動表

截至二零零二年十二月三十一日止年度

	附註	二零零二年 一月一日至 二零零二年 十二月三十一日 港元	二零零一年 一月一日至 二零零一年 十二月三十一日 港元
年初結餘		27,696,374,409	28,562,583,718
發行基金單位以換取現金之收益(不包括等值股息金額及進一步現金款額)	9	21,977,187,395	35,163,093,537
贖回基金單位之實物付款(不包括等值股息金額及進一步現金款額)	9	(21,201,788,593)	(30,789,315,970)
發行基金單位之實物收益(不包括等值股息金額及進一步現金款額)	9	164,854,488	2,565,446,791
於發行及贖回基金單位時已(支付)/收取之進一步淨現金款額		<u>(164,492)</u>	<u>27,730,147</u>
		28,636,463,207	35,529,538,223
轉撥至營運報表之數額(不包括轉撥至分派報表之數額)		(4,986,867,508)	(7,814,857,870)
轉撥自/(至)分派報表之未分派收入		<u>25,541,421</u>	<u>(18,305,944)</u>
年末結餘		<u><u>23,675,137,120</u></u>	<u><u>27,696,374,409</u></u>

第十至十五頁之附註為財務報表之一部分。

## 現金流量表

截至二零零二年十二月三十一日止年度

	附註	二零零二年 一月一日至 二零零二年 十二月三十一日 港元	二零零一年 一月一日至 二零零一年 十二月三十一日 港元
<b>經營業務</b>			
已收股息		743,768,164	798,315,203
已收交易費		9,630,000	16,830,000
已收銀行利息		2,932,869	6,645,279
已收其他收入		9,914,953	10,404,617
已付海外預扣稅項		(37,297,678)	(32,878,173)
已付經理人費		(12,550,435)	(13,069,711)
已付信託人費		(12,550,435)	(13,069,711)
已付兌換代理人費		(4,056,000)	(6,964,810)
已付指數特許權費		(4,099,527)	(4,439,022)
已付過戶處費用		(3,230,293)	(3,745,315)
已付銀行手續費		(1,015,081)	(1,818,123)
已付出版及印刷費用		(2,657,558)	(3,017,321)
已付法律及其他專業費用		(620,981)	(546,688)
已付其他經營開支		(1,339,520)	(1,685,219)
於新增基金單位時已收取之等值股息金額		242,356,133	284,203,945
於贖回基金單位時已支付之等值股息金額		(205,092,192)	(205,450,184)
經營業務之現金流入淨額	6	724,092,419	829,714,767
<b>投資業務</b>			
購入投資	9	(23,273,846,288)	(37,777,758,322)
出售投資	9	1,452,168,082	2,583,833,081
		(21,821,678,206)	(35,193,925,241)
<b>融資</b>			
發行基金單位	9	21,977,187,395	35,163,093,537
於發行及贖回基金單位時已(支付)/收取之進一步淨現金款額		(162,048)	27,730,147
已付中期分派		(384,898,875)	(411,998,800)
已付末期分派		(468,178,725)	(435,238,650)
		21,123,947,747	34,343,586,234
現金及現金等值增加/(減少)		26,361,960	(20,624,240)
年初銀行結存		67,506,674	88,130,914
年末銀行結存		93,868,634	67,506,674

主要非現金交易之詳情請見第十四頁附註9。

第十至十五頁之附註為財務報表之一部分。

分派報表

截至二零零二年十二月三十一日止年度

	二零零二年 一月一日至 二零零二年 十二月三十一日 港元	二零零一年 一月一日至 二零零一年 十二月三十一日 港元
轉撥自營運報表之數額	878,619,021	828,931,506
轉撥自資本賬之未分派收入	—	18,305,944
中期分派		
— 已於二零零一年五月二十二日就2,574,992,500個基金單位 每單位支付0.16港元	—	(411,998,800)
— 已於二零零二年五月二十二日就2,565,992,500個基金單位 每單位支付0.15港元	(384,898,875)	—
末期分派		
— 已於二零零一年十一月二十二日就2,417,992,500個基金單位 每單位支付0.18港元	—	(435,238,650)
— 已於二零零二年十一月二十二日就2,753,992,500個基金單位 每單位支付0.17港元	(468,178,725)	—
轉撥至資本賬之未分派收入	<u>25,541,421</u>	<u>—</u>

第十至十五頁之附註為財務報表之一部分。

## 財務報表附註

### 1 盈富基金

盈富基金為「信託契據」所規管之單位信託基金。盈富基金根據香港證券條例第15條獲香港證券及期貨事務監察委員會(以下簡稱「證監會」)所認可。盈富基金亦已於香港聯合交易所有限公司(香港交易及結算所有限公司之附屬公司)上市。

盈富基金旨在提供與恒生指數之表現相符之投資成績。

根據盈富基金之經理人及信託人於一九九九年十月二十三日訂立之持續發售機制協議之終止條款，持續發售機制協議已於二零零二年十一月二日終止。

### 2 主要會計政策

編製財務報表所採納之主要會計政策載列如下：

#### (a) 編製基準

財務報表乃根據香港普遍採納之會計原則編製，並符合香港會計師公會所頒佈之會計準則。財務報表乃按照歷史成本常規法及就投資之重估而予以修訂。

#### (b) 投資

於香港聯合交易所有限公司(以下簡稱「聯交所」)掛牌，上市或作一般買賣之投資，按聯交所之收市按盤價列賬。倘若投資價格未能於有關時間在聯交所取得，或聯交所之收市按盤價被視為不可提供經理人所作有關投資之公平值，則投資須按認可經紀或可能由經理人委任以進行估值並經信託人及監督委員會批准之其他專業人士核證之價值列賬。

購買及出售投資按交易日基準入賬。

出售投資之已變現損益及重估投資之未變現損益於營運報表內處理。

#### (c) 收入

股本證券之股息收入於除息日入賬。無除息日之股本證券之股息收入在盈富基金收取股息之權利獲確定時入賬。

銀行利息及其他收入按應計基準入賬。

## 財務報表附註(續)

### 2 主要會計政策(續)

#### (d) 開支

所有開支均按應計基準入賬。

#### (e) 等值股息金額

等值股息金額指於已發行或贖回基金單位之發行價或贖回款項(視乎情況而定)已包括之數額,即盈富基金已收取及持有或應收取之未分派股息及其他收入之淨額。

#### (f) 進一步現金款額

進一步現金款額指於已發行或贖回基金單位之發行價或贖回款項(視乎情況而定)已包括之數額,即經理人於新增基金單位當日所計算每新增基金單位之資產淨值,與一籃子指數股份之價值(按該日之收市按盤價計算)及每新增基金單位之等值股息金額兩者之差額。

#### (g) 開辦費用

由盈富基金承擔的開辦費用在盈富基金設立之首五年內攤銷。

### 3 收入

#### (a) 交易費

就新增基金單位或贖回基金單位之每項申請,盈富基金均有權收取每項申請**30,000**港元之交易費。

#### (b) 其他收入

其他收入指於有關分派之每個記錄日期向以其名義登記持有基金單位之基金單位持有人(香港結算代理人除外)收取之過戶費。目前該等收費為每位基金單位持有人每年**80**港元。該等收費每半年從應付予有關基金單位持有人之半年分派中扣除。

財務報表附註(續)

4 已發行基金單位

	基金單位數目	
	二零零二年 一月一日至 二零零二年 十二月三十一日	二零零一年 一月一日至 二零零一年 十二月三十一日
年初已發行之基金單位	2,417,992,500	1,882,992,500
發行基金單位		
— 現金認購	2,130,000,000	2,640,000,000
— 實物	17,000,000	188,000,000
贖回實物基金單位	(2,042,000,000)	(2,293,000,000)
年末已發行之基金單位	<u>2,522,992,500</u>	<u>2,417,992,500</u>

5 稅項

由於根據香港稅務條例第14條、第26條或第26A條，利息、股息收入及出售盈富基金之投資所得之已變現收益均毋須繳付利得稅，因此並無提撥香港利得稅準備。

海外預扣稅項按年內所收取之若干股息收入計算。

6 可供分派收入淨額與經營業務之現金流入淨額之對賬

	二零零二年 一月一日至 二零零二年 十二月三十一日 港元	二零零一年 一月一日至 二零零一年 十二月三十一日 港元
可供分派收入淨額	878,619,021	828,931,506
以股代息之收入	(155,280,708)	—
增加應收股息	(538,958)	(481,757)
減少開辦費用及其他應收賬款及預付款項	489,727	1,175,246
減少應付信託人費	(59,054)	(235,715)
減少應付經理人費	(59,054)	(235,715)
(減少)/增加應付過戶處費用	(13,400)	5,000
減少應付指數特許權費	(19,685)	(81,046)
減少交易費	—	(551,976)
(減少)/增加其他應付賬款及應計項目	(95,267)	1,189,224
淨增加贖回基金單位之應付賬款(不包括贖回基金單位之進一步現金應付賬款)	1,049,797	—
經營業務之現金流入淨額	<u>724,092,419</u>	<u>829,714,767</u>

## 財務報表附註(續)

## 7 與經理人及其關連人士之交易

經理人之關連人士指「證監會守則」中所界定之關連人士。所有盈富基金與經理人及其關連人士於年內訂立之交易均在日常業務範圍內按一般商業條款訂立。就經理人所知，除下文所披露者外，盈富基金並無與關連人士進行任何其他交易。

經理人之董事及高級人員可以盈富基金單位代理人身份進行交易，惟須事先取得信託人之書面同意。於二零零二年十二月三十一日，經理人之董事及高級人員於盈富基金合共持有101,160個基金單位(二零零一年：32,700個基金單位)。

## (a) 經理人費

應付經理人之費用按盈富基金於有關季度最後一個交易日之資產淨值以年率計算如下：

資產淨值首150億港元	0.050%
資產淨值接續之150億港元	0.045%
資產淨值接續之150億港元	0.030%
資產淨值超過450億港元之任何數額	0.025%

經理人費按日累計，並須於每季期末繳付。

## (b) 信託人費

應付信託人之費用按盈富基金於有關季度最後一個交易日之資產淨值以年率計算如下：

資產淨值首150億港元	0.050%
資產淨值接續之150億港元	0.045%
資產淨值接續之150億港元	0.030%
資產淨值超過450億港元之任何數額	0.025%

信託人費按日累計，並須於每季期末繳付。

## (c) 銀行結存

銀行結存由信託人保管。於二零零二年十二月三十一日，信託人所持有之銀行結存為93,868,634港元(於二零零一年十二月三十一日：67,506,674港元)。期內，上述銀行結存所賺取之利息為2,931,438港元(截至二零零一年十二月三十一日止期間：6,601,814港元)。

## 財務報表附註(續)

## 8 其他費用

## (a) 過戶處費用

應付過戶處之費用按有關月份之首個營業日在登記冊上之基金單位持有人數目，依照以下收費表計算，惟每月過戶處費用總額最高為1,000,000港元：

港元(每月)

首2,000名基金單位持有人	9,500
其後每1,000名基金單位持有人，至100,000名基金單位持有人為限	2,000
其後每1,000名基金單位持有人，至200,000名基金單位持有人為限	1,800
其後每1,000名基金單位持有人，至300,000名基金單位持有人為限	1,500
超過300,000名基金單位持有人之其後每1,000名基金單位持有人	1,200

此外，過戶處可獲付還為履行其服務而實際支付之所有費用。

過戶處費用按日累計，並須每月預先繳付。

## (b) 兌換代理人費

兌換代理人收取每月保管費16,000港元另加每次新增及贖回申請之交易費12,000港元，或最低月費36,000港元(以較高者為準)。

兌換代理人費按日累計，並須每月期末繳付。

## (c) 指數特許權費

指數特許權費按盈富基金每日平均資產淨值以年率0.015%計算，惟每年最低付款額為10,000美元。

指數特許權費按日累計，並須每季期末繳付。

## 9 主要非現金交易

按照盈富基金之「信託契據」，基金單位可透過現金認購或設立一籃子指數股份之方式發行。在後者之情況下，盈富基金可按每個新增基金單位(即1,000,000個基金單位)，收取由經理人每日釐定之成份股所組成之一籃子指數股份。除於年內以現金21,977,187,395港元(二零零一年：35,163,093,537港元)(註一)發行之2,130,000,000單位(二零零一年：2,640,000,000個基金單位)外，盈富基金亦已發行17,000,000個基金單位(二零零一年：188,000,000個基金單位)，以換取一籃子指數股份，該等股份是由經理人於發行當時估值合共為164,854,488港元(二零零一年：2,565,446,791港元)(註一)之投資所組成。

註一：不包括等值股息金額及進一步現金款額



## 財務報表附註(續)

## 9 主要非現金交易(續)

按照盈富基金之「信託契據」，基金單位只可以實物方式贖回，不得以現金方式贖回。年內，盈富基金已贖回2,042,000,000個基金單位(二零零一年：2,293,000,000個基金單位)，以換取由經理人估值合共為21,201,788,593港元(二零零一年：30,789,315,970港元)(註一)之投資所組成之一籃子指數股份。

## 10 收取非金錢利益

經理人可經由或透過其他人士之代理人代表盈富基金進行交易，惟任何該交易須符合「最佳執行」之標準，而經理人或任何關連人士與有關代理人已作出安排，據此該代理人將不時提供或促使經理人或其任何關連人士提供商品、服務或其他利益(例如研究及諮詢服務、電腦硬件連帶特設軟件或研究服務及表現量度服務)，其性質乃彼等所提供之該等商品、服務或其他利益預期可使盈富基金整體獲益，並可為改善盈富基金之表現作出貢獻。為釋疑問，該等商品及服務並不包括旅遊、住宿、娛樂、一般行政商品或服務、一般辦公室設備或寫字樓、會籍費用、僱員薪金或直接金錢款項。

自盈富基金成立以來，經理人並無就與基金戶口有關的交易收取任何非金錢利益。

## 11 證監會守則之投資限制及禁制條款

信託人及經理人獲得豁免遵守根據「證監會守則」有關禁止盈富基金持有任何單一發行人之投資超過盈富基金資產淨值10%之規定。該豁免僅適用於佔恒生指數之比重超過10%之任何證券，而盈富基金於任何個別證券之投資不得超過該等證券於恒生指數之比重。

於二零零二年十二月三十一日在盈富基金資產淨值所佔比重超過10%之成份股如下：

	所佔恒生指數之百分比		所佔資產淨值之百分比	
	二零零二年 十二月 三十一日	二零零一年 十二月 三十一日	二零零二年 十二月 三十一日	二零零一年 十二月 三十一日
匯豐控股有限公司	30.1	27.2	30.0	27.2
中國移動(香港)有限公司	13.6	16.3	13.5	16.2

## 12 財務報表通過

財務報表已於二零零三年三月二十八日由信託人及經理人通過。

註一：不包括等值股息金額及進一步現金款額

## 投資組合

於二零零二年十二月三十一日

	持股量	市值 港元	佔資產 淨值之 百分比
<b>香港</b>			
<b>上市投資(99.6%)</b>			
<b>股份(99.6%)</b>			
<b>地產(12.4%)</b>			
長江實業(集團)有限公司	20,348,397	1,032,681,148	4.4
恒隆地產有限公司	25,366,904	191,520,125	0.8
恒基兆業發展有限公司	24,752,405	178,217,316	0.8
恒基兆業地產有限公司	15,126,258	353,954,437	1.5
信和置業有限公司	34,090,628	85,226,570	0.4
新鴻基地產發展有限公司	21,094,660	974,573,292	4.1
會德豐有限公司	17,843,837	94,572,336	0.4
		2,910,745,224	12.4
<b>金融(39.7%)</b>			
中銀香港(控股)有限公司	92,895,120	743,160,960	3.1
東亞銀行有限公司	12,701,079	169,559,405	0.7
恒生銀行有限公司	16,798,096	1,394,241,968	5.9
匯豐控股有限公司	83,296,298	7,101,009,404	30.0
		9,407,971,737	39.7
<b>公用事業(7.2%)</b>			
中電控股有限公司	21,156,161	664,303,455	2.8
香港電燈集團有限公司	18,748,589	553,083,376	2.3
香港中華煤氣有限公司	50,001,295	505,013,080	2.1
		1,722,399,911	7.2

## 投資組合 (續)

於二零零二年十二月三十一日

	持股量	市值 港元	佔資產 淨值之 百分比
<b>工商業(40.3%)</b>			
國泰航空有限公司	29,310,125	312,152,831	1.3
長江基建集團有限公司	19,803,298	264,374,028	1.1
中國移動(香港)有限公司	172,830,007	3,205,996,630	13.5
華潤創業有限公司	18,279,043	126,125,397	0.5
中國聯通股份有限公司	110,290,585	584,540,101	2.5
中信泰富有限公司	19,239,555	277,049,592	1.2
中國海洋石油有限公司	72,168,697	732,512,275	3.1
思捷環球控股有限公司	10,357,946	136,206,990	0.6
和記黃埔有限公司	37,453,341	1,827,723,041	7.7
德昌電機控股有限公司	32,279,979	275,993,820	1.2
聯想集團有限公司	65,913,920	171,376,192	0.7
利豐有限公司	25,400,777	187,965,750	0.8
地鐵有限公司	45,318,456	373,877,262	1.6
新世界發展有限公司	19,025,608	74,199,871	0.3
電訊盈科有限公司	204,436,361	251,456,724	1.1
上海實業控股有限公司	8,216,071	88,322,763	0.4
太古股份有限公司(A股)	8,223,334	245,055,353	1.0
電視廣播有限公司	3,846,008	94,611,797	0.4
九龍倉集團有限公司	21,498,729	316,031,316	1.3
		<u>9,545,571,733</u>	<u>40.3</u>
上市投資總額		23,586,688,605	99.6
其他資產淨值		<u>88,448,515</u>	<u>0.4</u>
於二零零二年十二月三十一日之資產淨值		<u><u>23,675,137,120</u></u>	<u><u>100.0</u></u>
投資總額，按成本		<u><u>26,246,031,743</u></u>	

## 投資組合變動表

截至二零零二年十二月三十一日止年度

	持股量			於二零零二年 十二月三十一日 之總額
	於二零零一年 十二月三十一日 之總額	增持	出售	
<b>香港</b>				
<b>上市投資</b>				
<b>股份</b>				
<b>地產</b>				
長江實業(集團)有限公司	20,411,338	18,029,675	18,092,616	20,348,397
長江生命科技(集團)有限公司認股權	—	827,470	827,470	—
恒隆集團有限公司	11,669,135	10,235,950	21,905,085	—
恒隆地產有限公司	25,461,230	22,485,739	22,580,065	25,366,904
恒基兆業發展有限公司	24,827,094	21,924,976	21,999,665	24,752,405
恒基兆業地產有限公司	15,176,023	13,402,689	13,452,454	15,126,258
希慎興業有限公司	9,086,227	7,994,810	17,081,037	—
信和置業有限公司	34,036,577	30,330,523	30,276,472	34,090,628
新鴻基地產發展有限公司	21,160,599	18,687,827	18,753,766	21,094,660
會德豐有限公司	17,899,806	15,821,226	15,877,195	17,843,837
<b>金融</b>				
中銀香港(控股)有限公司	—	97,601,300	4,706,180	92,895,120
東亞銀行有限公司	12,629,311	11,319,838	11,248,070	12,701,079
恒生銀行有限公司	16,850,835	14,887,061	14,939,800	16,798,096
匯豐控股有限公司	82,447,719	75,680,697	74,832,118	83,296,298
<b>公用事業</b>				
中電控股有限公司	21,354,330	18,752,802	18,950,971	21,156,161
香港電燈集團有限公司	18,807,419	16,608,665	16,667,495	18,748,589
香港中華煤氣有限公司	46,040,596	48,088,590	44,127,891	50,001,295
<b>工商業</b>				
國泰航空有限公司	29,347,907	25,972,019	26,009,801	29,310,125
長江基建集團有限公司	19,864,834	17,543,335	17,604,871	19,803,298
中國移動(香港)有限公司	163,969,754	156,465,247	147,604,994	172,830,007
華潤創業有限公司	17,766,840	16,667,325	16,155,122	18,279,043
中國聯通股份有限公司	110,631,561	97,816,916	98,157,892	110,290,585
中信泰富有限公司	19,300,553	17,045,138	17,106,136	19,239,555
中國海洋石油有限公司	72,391,495	63,975,725	64,198,523	72,168,697
思捷環球控股有限公司	—	10,883,590	525,644	10,357,946
和記黃埔有限公司	37,570,800	33,178,904	33,296,363	37,453,341
德昌電機控股有限公司	32,379,812	28,628,934	28,728,767	32,279,979
聯想集團有限公司	66,196,512	58,523,157	58,805,749	65,913,920
利豐有限公司	25,372,348	22,489,330	22,460,901	25,400,777
地鐵有限公司	44,550,964	41,661,259	40,893,767	45,318,456
新世界發展有限公司	18,807,838	17,038,586	16,820,816	19,025,608
電訊盈科有限公司	199,998,309	182,526,507	178,088,455	204,436,361
上海實業控股有限公司	7,914,616	7,464,100	7,162,645	8,216,071
太古股份有限公司(A股)	8,284,434	7,313,209	7,374,309	8,223,334
電視廣播有限公司	3,860,112	3,408,967	3,423,071	3,846,008
九龍倉集團有限公司	21,565,591	19,044,567	19,111,429	21,498,729

## 行政及管理

### 經理人之董事

Vincent Duhamel (杜漢文) 先生  
John Serhant 先生

### 監督委員會委員

張建東先生  
方俠先生  
李陳倩文女士 (於二零零三年  
三月十一日辭任)  
簡嘉蘭女士  
霍廣文先生

### 信託人及託管人

美國道富銀行  
香港  
中環  
康樂廣場8號  
交易廣場第二座32樓

### 過戶處

香港中央證券登記有限公司  
香港  
皇后大道東183號  
合和中心17樓  
1712-1716室

### 經理人法律顧問

富而德律師事務所  
香港  
中環  
交易廣場第二座11樓

### 信託人法律顧問

安理國際律師事務所  
香港  
中環  
交易廣場第三座9樓

### 經理人

道富環球投資管理亞洲有限公司  
香港  
中環  
康樂廣場8號  
交易廣場第二座32樓

### 發起人

外匯基金投資有限公司  
香港  
中環  
花園道3號30樓

### 兌換代理人

香港證券兌換代理服務有限公司  
香港  
中環  
德輔道中199號  
維德廣場2樓

### 核數師

羅兵咸永道會計師事務所  
香港  
中環  
太子大廈22樓

## 業績紀錄

## 資產淨值

	每基金單位 資產淨值 港元	盈富基金 資產淨值 港元
於財政期間終結日		
二零零零年十二月三十一日	15.17	28,562,583,718
二零零一年十二月三十一日	11.45	27,696,374,409
二零零二年十二月三十一日	9.38	23,675,137,120

## 每基金單位之最高及最低資產淨值

	每基金單位之 最高資產淨值 港元	每基金單位之 最低資產淨值 港元
財政期間		
截至二零零零年十二月三十一日(自成立以來)	18.39	13.75
截至二零零一年十二月三十一日	16.24	9.12
截至二零零二年十二月三十一日	12.07	9.06