

盈富基金

Tracker Fund of Hong Kong

盈富基金

股份代號：2800

網 址：www.trahk.com.hk

二零一一年中期業績報告

二零一一年一月一日至二零一一年六月三十日

STATE STREET
GLOBAL ADVISORS
道富環球投資管理

目錄

| | |
|----|----------------------------|
| 1 | 簡明資產淨值報表（未經審核） |
| 2 | 簡明全面收入報表（未經審核） |
| 3 | 簡明可贖回基金單位持有人應佔淨資產變動表（未經審核） |
| 4 | 簡明現金流量表（未經審核） |
| 5 | 未經審核簡明財務報表附註 |
| 13 | 投資組合（未經審核） |
| 15 | 投資組合變動表（未經審核） |
| 17 | 業績紀錄 |
| 18 | 行政及管理 |

盈富基金

二零一一年中期業績報告

簡明資產淨值報表

於二零一一年六月三十日

| | | (未經審核) 二零一一年 六月三十日 港元 | (已經審核) 二零一零年 十二月三十一日 港元 |
|--------------------------------|------|--------------------------------|----------------------------------|
| 資產 | | | |
| 流動資產 | | | |
| 投資 | | 55,577,595,852 | 53,152,791,728 |
| 應收股息 | | 440,228,591 | 57,356,296 |
| 發行基金單位的應收賬項 | | — | 262,557 |
| 其他應收賬項及預付款項 | | 282,668 | 44,998 |
| 銀行結存 | 7(d) | 447,810,357 | 89,961,441 |
| | | <u>56,465,917,468</u> | <u>53,300,417,020</u> |
| 負債 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 應付經理人費 | | 5,171,431 | 5,139,723 |
| 應付信託人費 | | 5,171,431 | 5,139,723 |
| 應付指數特許權費 | | 2,105,378 | 1,949,588 |
| 應付過戶處費用 | | 145,919 | 145,041 |
| 其他應付賬項及應計款項 | | 544,593 | 728,284 |
| | | <u>13,138,752</u> | <u>13,102,359</u> |
| 負債（不包括可贖回基金單位持有人 應佔淨資產） | | <u>13,138,752</u> | <u>13,102,359</u> |
| 可贖回基金單位持有人應佔淨資產 （按買入市價計算） | | 56,452,778,716 | 53,287,314,661 |
| 由買入市價調整至最後交易市價 | 5 | <u>84,907,651</u> | <u>89,888,106</u> |
| 可贖回基金單位持有人應佔淨資產 （按最後交易市價計算） | 5 | <u>56,537,686,367</u> | <u>53,377,202,767</u> |

第五至十二頁之附註為簡明財務報表之一部分。

簡明全面收入報表

截至二零一一年六月三十日止期間

| | 附註 | (未經審核) | |
|-------------------------------------|------|--|--|
| | | 二零一一年 一月一日至 二零一一年 六月三十日 港元 | 二零一零年 一月一日至 二零一零年 六月三十日 港元 |
| 收入 | | | |
| 股息 | | 1,103,789,030 | 814,554,467 |
| 交易費 | 4(a) | 588,734 | 374,447 |
| 其他收入 | 4(b) | 2,117,467 | 2,177,156 |
| 投資淨虧損 | 3 | (1,531,230,130) | (2,902,866,844) |
| 淨虧損總額 | | (424,734,899) | (2,085,760,774) |
| 支出 | | | |
| 經理人費 | 7(b) | 10,504,417 | 9,075,479 |
| 信託人費 | 7(c) | 10,504,417 | 9,075,479 |
| 指數特許權費 | 8(c) | 4,071,144 | 3,015,398 |
| 交易支出 | | 7,831,650 | 5,627,555 |
| 過戶處費用 | 8(a) | 820,996 | 867,412 |
| 出版及印刷費用 | | 690,871 | 470,185 |
| 兌換代理人費 | 8(b) | 558,906 | 394,769 |
| 核數費 | | 163,644 | 123,972 |
| 法律及其他專業費用 | | 127,534 | 480,217 |
| 銀行手續費 | | 188,413 | 151,101 |
| 其他經營支出 | | 296,211 | 363,577 |
| 總經營支出 | | 35,758,203 | 29,645,144 |
| 經營虧損 | | (460,493,102) | (2,115,405,918) |
| 融資成本 | | | |
| 分派予可贖回基金單位持有人的金額 | 12 | (312,779,025) | (226,919,100) |
| 分派後的除稅前虧損 | | (773,272,127) | (2,342,325,018) |
| 預扣所得稅 | 6 | (63,194,945) | (47,140,803) |
| 分派後的除稅後虧損 | | (836,467,072) | (2,389,465,821) |
| 由買入市價調整至最後交易市價 | 5 | (4,980,455) | 36,923,384 |
| 由經營而來的可贖回基金單位持有人 應佔淨資產減少 | | (841,447,527) | (2,352,542,437) |

第五至十二頁之附註為簡明財務報表之一部分。

盈富基金

二零一一年中期業績報告

簡明可贖回基金單位持有人應佔淨資產變動表

截至二零一一年六月三十日止期間

| | 附註 | (未經審核) | |
|-----------------------------------|----|--|--|
| | | 二零一一年 一月一日至 二零一一年 六月三十日 港元 | 二零一零年 一月一日至 二零一零年 六月三十日 港元 |
| 期初可贖回基金單位持有人應佔 淨資產 (按最後交易市價計算) | | 53,377,202,767 | 39,127,011,685 |
| 基金單位發行 | | | |
| — 以實物支付 | 9 | 11,590,016,774 | 8,263,678,322 |
| — 現金款項 | 9 | 65,204,494 | 41,791,742 |
| | | <u>11,655,221,268</u> | <u>8,305,470,064</u> |
| 基金單位贖回 | | | |
| — 以實物支付 | 9 | (7,623,545,183) | (3,868,748,094) |
| — 現金款項 | 9 | (29,744,958) | (17,493,921) |
| | | <u>(7,653,290,141)</u> | <u>(3,886,242,015)</u> |
| 基金單位發行淨額 | | <u>4,001,931,127</u> | <u>4,419,228,049</u> |
| 由經營而來的可贖回基金單位持有人 應佔淨資產減少 | | <u>(841,447,527)</u> | <u>(2,352,542,437)</u> |
| 期末可贖回基金單位持有人應佔 淨資產 (按最後交易市價計算) | | <u>56,537,686,367</u> | <u>41,193,697,297</u> |

第五至十二頁之附註為簡明財務報表之一部分。

簡明現金流量表

截至二零一一年六月三十日止期間

| | 附註 | (未經審核) | |
|-----------------------|----------|----------------------------------|----------------------------------|
| | | 二零一一年 一月一日至 二零一一年 六月三十日 | 二零一零年 一月一日至 二零一零年 六月三十日 |
| | | 港元 | 港元 |
| 經營活動之現金流 | | | |
| 出售投資收入 | | 3,602,314,212 | 2,573,912,093 |
| 購入投資支出 | | (3,591,876,875) | (2,518,103,713) |
| 已收股息 | | 657,721,790 | 611,596,003 |
| 已收交易費 | | 615,000 | 495,000 |
| 已付經理人費 | | (10,472,709) | (8,802,656) |
| 已付信託人費 | | (10,472,709) | (8,802,656) |
| 已付指數特許權費 | | (3,915,354) | (2,985,658) |
| 已付過戶處費用 | | (820,118) | (849,180) |
| 已付出版及印刷費用 | | (759,668) | (818,657) |
| 已付交易成本 | | (7,831,650) | (5,627,555) |
| 已付兌換代理人費 | | (540,000) | (432,000) |
| 已付銀行手續費 | | (152,871) | (126,212) |
| 已付法律及其他專業費用 | | (167,578) | (480,217) |
| 已付其他經營支出 | | (853,089) | (711,953) |
| 經營活動產生之現金淨額 | | 632,788,381 | 638,262,639 |
| 融資活動之現金流 | | | |
| 已收基金單位發行之現金款項 | 9 | 65,467,051 | 41,791,742 |
| 已付基金單位贖回之現金款項 | 9 | (29,744,958) | (17,493,921) |
| 已付中期分派 | 4(b), 12 | (310,661,558) | (224,741,944) |
| 融資活動使用之現金淨額 | | (274,939,465) | (200,444,123) |
| 現金及等同現金項目之增加淨額 | | 357,848,916 | 437,818,516 |
| 期初現金及等同現金項目 | | 89,961,441 | 56,176,081 |
| 期末現金及等同現金項目 | | 447,810,357 | 493,994,597 |
| 現金及等同現金項目結餘分析 | | | |
| 銀行結存 | 7(d) | 447,810,357 | 493,994,597 |

主要非現金交易之詳情請見附註4(b)及附註9。
第五至十二頁之附註為簡明財務報表之一部分。

盈富基金

二零一一年中期業績報告

未經審核簡明財務報表附註

1 一般資料

盈富基金（以下簡稱「基金」）為一項受一九九九年十月二十三日訂立之信託契據（以下簡稱「信託契據」）所規管之單位信託基金。根據香港《證券及期貨條例》第104(1)條，基金獲香港證券及期貨事務監察委員會認可。基金現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。

基金之經理人及信託人分別為道富環球投資管理亞洲有限公司（以下簡稱「經理人」）及美國道富銀行（以下簡稱「信託人」）。

基金之目標為提供緊貼恒生指數（以下簡稱「指數」）表現之投資成績。

2 編制基準及會計政策

除以下所述，此未經審核簡明中期財務報表（「中期財務報表」）按照香港會計師公會頒佈的「香港會計準則」第34號之「中期財務報表」的規定而編制。本中期財務報表乃按照歷史成本常規法就投資之重估而予以修訂及應與二零一零年十二月三十一日止年度之財務報表一起閱讀。

本中期財務報表所採用的會計政策及計算方法，均與二零一零年十二月三十一日止年度之財務報表內所採用的會計政策及計算方法一致。

基金已採納的新增及經修訂準則：

香港會計準則第34號「中期財務報告」的修訂本於二零一一年一月一日或之後開始的年度期間起生效。此修訂本強調香港會計準則第34號的現有披露原則，並加入進一步指引以說明如何應用此等原則。此修訂本並進一步加強對重大事項和交易的披露原則。額外規定涵蓋公平值計量變動（如屬重大）的披露，以及需要更新自最近期年報刊發以來的相關資料。此會計政策的變動對本基金並無重大影響。

未經審核簡明財務報表附註（續）

3 淨投資虧損

| | （未經審核） | |
|---------------|--|--|
| | 二零一一年 一月一日至 二零一一年 六月三十日 港元 | 二零一零年 一月一日至 二零一零年 六月三十日 港元 |
| 未變現投資收益／虧損之變動 | (4,507,255,532) | (3,289,080,423) |
| 出售投資之已變現收益 | 2,976,025,402 | 386,213,579 |
| | <u>(1,531,230,130)</u> | <u>(2,902,866,844)</u> |

4 收入

(a) 交易費

申請新增及贖回單位只可透過已經與經理人、信託人、香港證券兌換代理服務有限公司和香港中央結算有限公司（「香港結算」）簽訂參與協議之經紀或交易商（作為當事人或代表客戶行事）（「參與交易商」）進行。基金有權向每個參與交易商按每日總新增及贖回申請收取15,000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基金單位持有人（香港結算代理人除外）就以其名義登記持有的基金單位收取之過戶費。目前該等收費為每位基金單位持有人每年80港元或相等於該基金單位持有人之實際應得分派金額（以金額較少者作為最終收費）。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。

5 已發行基金單位數目及可贖回基金單位持有人應佔淨資產

基金的資本乃以可贖回基金單位持有人應佔淨資產代表。基金單位透過設立一籃子指數股份連現金餘額之方式發行並以實物方式連現金餘額贖回。期內基金單位之認購及贖回呈列於簡明可贖回基金單位持有人應佔淨資產變動表。根據目標及風險管理政策，基金努力投資於合適的投資項目而同時維持足夠的流動性以配合基金贖回，有需要時會透過出售上市股份以維持基金的流動性。

盈富基金

二零一一年中期業績報告

未經審核簡明財務報表附註(續)

5 已發行基金單位數目及可贖回基金單位持有人應佔淨資產(續)

根據基金之信託契據規定，為新增和贖回及多項其他收費而釐定每單位資產淨值時，上市投資乃按估值日的最後交易價入賬。然而，為符合香港會計準則第39號及相關之呈報，投資乃按結算日之有關買入市價估值。因為簡明財務報表所呈列之投資估值與基金信託契據所述之估值方法的差異，導致於二零一一年六月三十日投資價值減少84,907,651港元(二零一零年十二月三十一日：89,888,106港元)。於簡明全面收入報表內確認的調整數額為減少4,980,455港元(截至二零一零年六月三十日止期間：增加36,923,384港元)。

按最後交易市價計算之可贖回基金單位持有人應佔資產淨值在簡明資產淨值報表中列作負債，其應付贖回金額指於結算日倘若基金單位持有人行使贖回基金單位之權利而應付之金額。

| | (未經審核) 基金單位數目 | | |
|--|----------------------------------|------------------------------------|----------------------------------|
| | 二零一一年 一月一日至 二零一一年 六月三十日 | 二零一零年 七月一日至 二零一零年 十二月三十一日 | 二零一零年 一月一日至 二零一零年 六月三十日 |
| 期初已發行之基金單位 | 2,301,992,500 | 2,005,992,500 | 1,776,992,500 |
| 新增之基金單位 | 491,000,000 | 361,000,000 | 403,000,000 |
| 贖回之基金單位 | (318,000,000) | (65,000,000) | (174,000,000) |
| 期末已發行之基金單位 | <u>2,474,992,500</u> | <u>2,301,992,500</u> | <u>2,005,992,500</u> |
| | 港元 | 港元 | 港元 |
| 可贖回基金單位持有人應佔淨資產 | <u>56,537,686,367</u> | <u>53,377,202,767</u> | <u>41,193,697,297</u> |
| 可贖回基金單位持有人應佔淨資產 (每基金單位) | <u>22.84</u> | <u>23.19</u> | <u>20.54</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>22,843,579</u> | <u>23,187,392</u> | <u>20,535,320</u> |

未經審核簡明財務報表附註（續）

6 稅項

根據香港《稅務條例》第14條、第26條或第26A條，基金之利息、股息收入及出售投資所得之已變現收益均毋須繳付利得稅，因此並無就香港利得稅撥備。

基金投資於香港聯合交易所上市之中華人民共和國（以下簡稱「中國」）公司股份（以下簡稱「H股」）。根據中國企業所得稅法，基金可能需繳付買賣H股所得之中國資本利得稅。然而，本財務報表中並無就此利得稅務責任作出撥備，因為信託人及經理人相信基金就現行稅法可以繼續保持無需申報稅務狀況，及不大可能需要繳付中國資本利得稅。

期內所得的H股股息已繳付股息預扣稅。

7 與關聯方／經理人及其關連人士之交易

關聯方是指其中一方有能力控制另一方或可對另一方的財務及經營決策發揮重大影響力。基金之經理人及其關連人士均屬基金之關聯方。經理人之關連人士指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」）中所界定之關連人士。期內基金與其關聯方，包括經理人及其關連人士訂立之所有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，除下文所披露之交易外，基金並無與關聯方，包括經理人及其關連人士進行任何其他交易。

(a) 經理人所持有之基金單位

經理人之董事及高級人員可以以基金單位代理人身份買賣基金單位，惟須事先取得信託人之書面同意。於二零一一年六月三十日，經理人之董事及高級人員合共持有基金的23,500個基金單位（二零一零年十二月三十一日：23,500個單位）。

(b) 經理人費

應付經理人之費用按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。

盈富基金

二零一一年中期業績報告

未經審核簡明財務報表附註(續)

7 與關聯方／經理人及其關連人士之交易(續)

(c) 信託人費

應付信託人之費用按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。

(d) 銀行結存

銀行結存由信託人保管。於二零一一年六月三十日，信託人所持有之銀行結餘為447,810,357港元(二零一零年十二月三十一日：89,961,441港元)。截至二零一一年及二零一零年六月三十日止兩段期間，因現金結餘存放於無息支票戶口，上述銀行結餘沒有賺取利息。

8 其他費用

(a) 過戶處費用

應付過戶處「香港中央證券登記」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 | 10,000 |
| 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 | 2,200 |
| 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，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「香港證券兌換代理服務有限公司」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。

兌換代理人費按日累計，並須每月期末繳付。

未經審核簡明財務報表附註（續）**8 其他費用（續）***(c) 指數特許權費*

指數特許權費按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

按照基金之信託契據，基金單位只可透過設立一籃子指數股份連現金餘額之方式發行。基金可按每個新增基金單位（即1,000,000個基金單位），收理由經理人每日釐定之成份股所組成之一籃子指數股份。期內，基金已發行491,000,000個基金單位（截至二零一零年六月三十日止期間：403,000,000個基金單位）合共11,655,221,268港元（截至二零一零年六月三十日止期間：8,305,470,064港元），以換取投資組合（由經理人估值）合共11,590,016,774港元（截至二零一零年六月三十日止期間：8,263,678,322港元）之一籃子指數股份與現金餘額65,204,494港元（截至二零一零年六月三十日止期間：41,791,742港元）。

按照基金之信託契據，基金單位以實物方式連現金餘額贖回。期內，基金已贖回318,000,000個基金單位（截至二零一零年六月三十日止期間：174,000,000個基金單位）合共7,653,290,141港元（截至二零一零年六月三十日止期間：3,886,242,015港元），以換取投資組合（由經理人估值）合共為港元7,623,545,183（截至二零一零年六月三十日止期間：3,868,748,094港元）之一籃子指數股份與現金餘額29,744,958港元（截至二零一零年六月三十日止期間：17,493,921港元）。

10 非金錢利益安排

經理人可經由或透過其他人士之代理人代表基金進行交易，惟任何交易均須符合「最佳執行」之標準，而根據經理人或其任何關連人士作出的安排，所提供的商品、服務或其他利益（例如研究及諮詢服務、電腦硬件連特設軟件或研究服務及表現量度服務），其性質均預期可使基金整體獲益，並可為改善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。

自基金成立以來，經理人並無就基金任何交易參與任何非金錢利益安排。

盈富基金

二零一一年中期業績報告

未經審核簡明財務報表附註(續)

11 證監會守則之投資限制及禁制條款

證監會守則容許基金將其10%以上的資產淨值投資於由同一名發行人發行的恒生指數成份股。惟此條款僅適用於佔恒生指數的比重超過10%之成份股，而基金於任何個別成份股之投資比重不得超逾該成份股於恒生指數之比重(然而，如果超逾比重的情況是由於指數組合出現變化所引致，及只屬過渡性和暫時性的，則不在此限)。

於二零一一年六月三十日，佔基金資產淨值比重超過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 | |
|----------|----------------|------------------|----------------|------------------|
| | 二零一一年 六月三十日 | 二零一零年 十二月三十一日 | 二零一一年 六月三十日 | 二零一零年 十二月三十一日 |
| 滙豐控股有限公司 | 15.0 | 15.1 | 14.6 | 15.0 |

期內，恒生指數下跌2.77%(截至二零一零年六月三十日止期間：7.97%)，而同期基金之每基金單位資產淨值下跌1.51%(截至二零一零年六月三十日止期間：6.72%)

12 分派

(未經審核)

| | 二零一一年 一月一日至 二零一一年 六月三十日 | 二零一零年 一月一日至 二零一零年 六月三十日 |
|---|----------------------------------|----------------------------------|
| 中期分派 | | |
| — 已於二零一零年五月二十八日就 1,890,992,500個基金單位每單位 支付0.12港元 | — | 226,919,100 |
| — 已於二零一一年六月一日就2,405,992,500 個基金單位每單位支付0.13港元 | 312,779,025 | — |

未經審核簡明財務報表附註（續）

13 分部資料

經理人代表基金進行策略性資源分配，並根據用以作出策略性決定之基金報告來釐定營運分部。

經理人負責基金的整體投資組合，並認為基金只有一個營運分部。經理人根據單一及完整統一的投資策略，作出資源分配決定，而基金表現則根據全面的基礎來評價。

基金投資於香港恒生指數成份股，旨在提供緊貼恒生指數表現之投資成績。

提供予經理人有關基金資產、負債及表現的內部報告的編制準則，與香港財務報告準則的計量和確認原則符合一致。

期內可報告分部並無變更。

基金於香港運作。基金的所有投資收入皆來自香港的上市機構。

基金沒有資產被分類為非流動資產。基金擁有一個高度分散的投資組合，沒有單一投資佔基金收入超過10%。請見附註11有關佔基金淨資產超過10%的投資持倉。

基金亦擁有一個高度分散的基金單位持有人組合。然而，於二零一一年六月三十日和二零一零年十二月三十一日，有一家代理人公司持有佔基金10%以上的淨資產。該代理人公司於二零一一年六月三十日持有81.84%及於二零一零年十二月三十一日持有80.14%。

盈富基金

二零一一年中期業績報告

投資組合

於二零一一年六月三十日

| | (未經審核) | | 佔資產淨值 之百分比 |
|---------------------|-------------|-----------------------|---------------|
| | 持股量 | 公平價值 港元 | |
| 香港 | | | |
| 上市投資(98.30%) | | | |
| 股份(98.30%) | | | |
| 地產(9.26%) | | | |
| 長江實業(集團)有限公司 | 12,383,807 | 1,405,562,094 | 2.49 |
| 中國海外發展有限公司 | 36,529,626 | 606,391,792 | 1.07 |
| 華潤置地有限公司 | 16,855,888 | 235,982,432 | 0.42 |
| 恒隆地產有限公司 | 21,977,420 | 701,079,698 | 1.24 |
| 恒基兆業地產有限公司 | 8,753,382 | 438,106,769 | 0.77 |
| 信和置業有限公司 | 23,509,244 | 292,925,180 | 0.52 |
| 新鴻基地產發展有限公司 | 13,743,323 | 1,557,118,496 | 2.75 |
| | | <u>5,237,166,461</u> | <u>9.26</u> |
| 金融(46.01%) | | | |
| 友邦保險控股有限公司 | 75,157,642 | 2,025,498,452 | 3.58 |
| 中國銀行股份有限公司 | 559,128,105 | 2,119,095,518 | 3.75 |
| 中銀香港(控股)有限公司 | 33,080,948 | 745,975,377 | 1.32 |
| 交通銀行股份有限公司 | 59,278,645 | 441,033,119 | 0.78 |
| 東亞銀行有限公司 | 13,711,236 | 438,073,990 | 0.77 |
| 中國建設銀行股份有限公司 | 536,000,598 | 3,457,203,857 | 6.11 |
| 中國人壽保險股份有限公司 | 66,324,535 | 1,760,916,404 | 3.11 |
| 恒生銀行有限公司 | 6,836,400 | 847,029,960 | 1.50 |
| 香港交易及結算所有限公司 | 9,128,277 | 1,488,821,979 | 2.63 |
| 滙豐控股有限公司 | 107,358,296 | 8,266,588,792 | 14.64 |
| 中國工商銀行股份有限公司 | 541,784,078 | 3,196,526,060 | 5.65 |
| 中國平安保險(集團)股份有限公司 | 15,276,733 | 1,224,430,150 | 2.17 |
| | | <u>26,011,193,658</u> | <u>46.01</u> |
| 公用事業(5.02%) | | | |
| 華潤電力控股有限公司 | 16,892,486 | 254,738,689 | 0.45 |
| 中電控股有限公司 | 16,132,564 | 1,110,727,031 | 1.96 |
| 香港中華煤氣有限公司 | 42,376,761 | 747,526,064 | 1.32 |
| 電能實業有限公司 | 12,401,697 | 727,359,529 | 1.29 |
| | | <u>2,840,351,313</u> | <u>5.02</u> |

投資組合(續)

於二零一一年六月三十日

| | (未經審核) | | 估資產 淨值之百分比 |
|--------------------|-------------|-----------------------|---------------|
| | 持股量 | 公平價值 港元 | |
| 工商業(38.01%) | | | |
| 中國鋁業股份有限公司 | 35,257,848 | 230,938,904 | 0.41 |
| 百麗國際控股有限公司 | 41,469,525 | 674,294,477 | 1.19 |
| 國泰航空有限公司 | 10,549,984 | 189,688,712 | 0.34 |
| 中國中煤能源股份有限公司 | 36,712,231 | 383,275,692 | 0.68 |
| 招商局國際有限公司 | 9,890,541 | 296,221,703 | 0.52 |
| 中國移動有限公司 | 53,684,093 | 3,862,570,491 | 6.83 |
| 中國石油化工股份有限公司 | 149,492,103 | 1,166,038,403 | 2.06 |
| 華潤創業有限公司 | 10,720,183 | 338,221,774 | 0.60 |
| 中國神華能源股份有限公司 | 30,381,813 | 1,127,165,262 | 1.99 |
| 中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司 | 42,127,433 | 660,558,149 | 1.17 |
| 中信泰富有限公司 | 11,415,740 | 221,693,671 | 0.39 |
| 中國海洋石油有限公司 | 159,322,312 | 2,893,293,186 | 5.12 |
| 中遠太平洋有限公司 | 14,546,221 | 197,828,606 | 0.35 |
| 思捷環球控股有限公司 | 11,527,343 | 277,808,966 | 0.49 |
| 恒安國際集團有限公司 | 7,075,180 | 491,371,251 | 0.87 |
| 和記黃埔有限公司 | 18,998,677 | 1,595,888,868 | 2.82 |
| 利豐有限公司 | 50,543,472 | 783,423,816 | 1.39 |
| 香港鐵路有限公司 | 12,901,741 | 354,797,878 | 0.63 |
| 新世界發展有限公司 | 21,287,962 | 249,920,674 | 0.44 |
| 中國石油天然氣股份有限公司 | 188,084,081 | 2,132,873,479 | 3.77 |
| 太古股份有限公司 'A' | 6,476,171 | 736,340,643 | 1.30 |
| 騰訊控股有限公司 | 9,004,995 | 1,892,849,949 | 3.35 |
| 九龍倉集團有限公司 | 13,539,683 | 731,819,866 | 1.30 |
| | | <u>21,488,884,420</u> | <u>38.01</u> |
| 上市投資總額 | | <u>55,577,595,852</u> | <u>98.30</u> |
| 投資總額，按成本計算 | | <u>48,259,255,290</u> | |

盈富基金

二零一一年中期業績報告

投資組合變動表

截至二零一一年六月三十日止期間

| | (未經審核) | | | 二零一一年 六月三十日 |
|------------------|------------------|-------------|---------------|----------------|
| | 二零一零年 十二月三十一日 | 增持 | 出售 | |
| 香港 | | | | |
| 上市投資 | | | | |
| 股份 | | | | |
| 地產 | | | | |
| 長江實業(集團)有限公司 | 12,281,887 | 2,608,348 | (2,506,428) | 12,383,807 |
| 中國海外發展有限公司 | 36,099,568 | 7,668,760 | (7,238,702) | 36,529,626 |
| 華潤置地有限公司 | 17,804,349 | 3,580,688 | (4,529,149) | 16,855,888 |
| 恒隆地產有限公司 | 18,412,944 | 7,611,341 | (4,046,865) | 21,977,420 |
| 恒基兆業地產有限公司 | 9,568,302 | 2,030,466 | (2,845,386) | 8,753,382 |
| 新礦資源有限公司－認購股權 | – | 125,998 | (125,998) | – |
| 信和置業有限公司 | 21,648,359 | 6,363,363 | (4,502,478) | 23,509,244 |
| 新鴻基地產發展有限公司 | 13,624,833 | 2,894,132 | (2,775,642) | 13,743,323 |
| 金融 | | | | |
| 友邦保險控股有限公司 | – | 75,492,075 | (334,433) | 75,157,642 |
| 中國銀行股份有限公司 | 554,145,624 | 117,703,832 | (112,721,351) | 559,128,105 |
| 中銀香港(控股)有限公司 | 32,693,349 | 6,944,691 | (6,557,092) | 33,080,948 |
| 交通銀行股份有限公司 | 58,586,601 | 12,444,806 | (11,752,762) | 59,278,645 |
| 東亞銀行有限公司 | 14,426,075 | 3,056,788 | (3,771,627) | 13,711,236 |
| 中國建設銀行股份有限公司 | 531,060,640 | 112,800,862 | (107,860,904) | 536,000,598 |
| 中國人壽保險股份有限公司 | 65,745,873 | 13,965,262 | (13,386,600) | 66,324,535 |
| 恒生銀行有限公司 | 6,759,502 | 1,435,427 | (1,358,529) | 6,836,400 |
| 香港交易及結算所有限公司 | 9,047,618 | 1,921,941 | (1,841,282) | 9,128,277 |
| 滙豐控股有限公司 | 100,651,300 | 26,105,600 | (19,398,604) | 107,358,296 |
| 中國工商銀行股份有限公司 | 498,472,631 | 150,109,035 | (106,797,588) | 541,784,078 |
| 中國平安保險(集團)股份有限公司 | 15,153,535 | 3,217,978 | (3,094,780) | 15,276,733 |
| 公用事業 | | | | |
| 華潤電力控股有限公司 | 16,639,413 | 3,539,166 | (3,286,093) | 16,892,486 |
| 中電控股有限公司 | 15,949,011 | 3,386,823 | (3,203,270) | 16,132,564 |
| 香港中華煤氣有限公司 | 38,073,766 | 12,196,393 | (7,893,398) | 42,376,761 |
| 電能實業有限公司 | 12,254,450 | 2,603,348 | (2,456,101) | 12,401,697 |

投資組合變動表 (續)

截至二零一一年六月三十日止期間

| | (未經審核) 持股量 | | | 二零一一年 六月三十日 |
|------------------------|------------------|------------|--------------|----------------|
| | 二零一零年 十二月三十一日 | 增持 | 出售 | |
| 工商業 | | | | |
| 中國鋁業股份有限公司 | 34,847,658 | 7,401,920 | (6,991,730) | 35,257,848 |
| 百麗國際控股有限公司 | 40,810,023 | 8,705,983 | (8,046,481) | 41,469,525 |
| 國泰航空有限公司 | 10,426,375 | 2,214,659 | (2,091,050) | 10,549,984 |
| 中國中煤能源股份有限公司 | 36,291,812 | 7,707,248 | (7,286,829) | 36,712,231 |
| 招商局國際有限公司 | 9,699,702 | 2,073,115 | (1,882,276) | 9,890,541 |
| 中國移動有限公司 | 53,181,803 | 11,297,137 | (10,794,847) | 53,684,093 |
| 中國石油化工股份有限公司 | 148,268,538 | 31,492,665 | (30,269,100) | 149,492,103 |
| 華潤創業有限公司 | 10,595,014 | 2,250,377 | (2,125,208) | 10,720,183 |
| 中國神華能源股份有限公司 | 30,033,553 | 6,378,429 | (6,030,169) | 30,381,813 |
| 中國聯合網絡通信(香港) 股份有限公司 | 41,638,207 | 8,843,961 | (8,354,735) | 42,127,433 |
| 中信泰富有限公司 | 11,283,163 | 2,396,746 | (2,264,169) | 11,415,740 |
| 中國海洋石油有限公司 | 157,875,502 | 33,533,353 | (32,086,543) | 159,322,312 |
| 中遠太平洋有限公司 | 14,378,775 | 3,053,352 | (2,885,906) | 14,546,221 |
| 思捷環球控股有限公司 | 10,815,859 | 2,304,406 | (1,592,922) | 11,527,343 |
| 富士康國際控股有限公司 | 18,938,395 | 3,837,689 | (22,776,084) | - |
| 恒安國際集團有限公司 | - | 7,106,750 | (31,570) | 7,075,180 |
| 和記黃埔有限公司 | 18,837,323 | 4,000,692 | (3,839,338) | 18,998,677 |
| 和記港口控股信託－認購股權 | - | 1,828,800 | (1,828,800) | - |
| 利豐有限公司 | 21,975,302 | 60,405,004 | (31,836,834) | 50,543,472 |
| 利豐有限公司－臨時買賣 | - | 52,946,026 | (52,946,026) | - |
| 香港鐵路有限公司 | 12,741,984 | 2,707,902 | (2,548,145) | 12,901,741 |
| 新世界發展有限公司 | 20,772,380 | 6,649,130 | (6,133,548) | 21,287,962 |
| 中國石油天然氣股份有限公司 | 186,423,411 | 39,597,395 | (37,936,725) | 188,084,081 |
| 太古股份有限公司‘A’ | 6,397,216 | 1,359,357 | (1,280,402) | 6,476,171 |
| 騰訊控股有限公司 | 8,879,985 | 1,906,551 | (1,781,541) | 9,004,995 |
| 九龍倉集團有限公司 | 12,167,482 | 3,994,978 | (2,622,777) | 13,539,683 |
| 九龍倉集團有限公司－供股權 | - | 1,173,427 | (1,173,427) | - |

盈富基金

二零一一年中期業績報告

業績紀錄

截至二零一一年六月三十日止期間

基金表現

期內，恒生指數下跌2.77%，而同期基金每基金單位資產淨值下跌1.51%。

行政及管理

經理人之董事

韋博能先生
Ms. Kelly Quinn Driscoll
李婷女士

監督委員會委員

方俠先生
霍廣文先生
張建東先生
羅承恩先生
陳玉樹教授

信託人及託管人

美國道富銀行
香港
中環
金融街8號
國際金融中心二期68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
17M樓

經理人

道富環球投資管理亞洲有限公司
香港
中環
金融街8號
國際金融中心二期68樓

發起人

外匯基金投資有限公司
香港
中環
金融街8號
國際金融中心二期87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
無限極廣場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