

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例 （%）
1	权益投资	12,728,404,218.00	87.33
	其中：普通股	11,999,761,150.33	82.33
	存托凭证	728,643,067.67	5.00
2	基金投资	403,868,404.68	2.77
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	5,103,481.50	0.04
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	5,103,481.50	0.04
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	959,832,844.00	6.59
8	其他各项资产	478,503,220.82	3.28
9	合计	14,575,712,169.00	100.00

截至2010年6月30日，本基金资产净值为14,210,391,993.59元，基金份额净值为0.555元，累计基金份额净值为0.555元。

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	4,938,839,077.72	34.76
澳大利亚	2,360,132,826.34	16.61
韩国	1,610,909,367.86	11.34
新加坡	596,098,693.46	4.19
印度	1,519,529,020.09	10.69
印度尼西亚	715,894,149.44	5.04
泰国	516,264,387.16	3.63
台湾	470,736,695.93	3.31
合计	12,728,404,218.00	89.57

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
商业银行业	2,167,207,296.47	15.25
房地产管理及开发业	1,029,403,862.19	7.24
石油，天然气及消耗燃料业	1,095,390,169.05	7.71
半导体及半导体设备业	590,614,973.49	4.16
保险业	619,804,074.84	4.36
金属及采矿业	1,158,199,016.69	8.15
食品零售业	565,912,404.13	3.98
汽车业	90,457,934.33	0.64
建筑及工程业	439,895,575.94	3.10

新闻传播业	212,378,680.51	1.49
建筑材料业	458,212,567.32	3.22
运输业	55,753,275.39	0.39
多元化金融服务业	449,118,265.47	3.16
多线零售业	236,792,286.10	1.67
网络软件及服务业	256,918,287.94	1.81
电子设备及元件业	101,841,498.73	0.72
机械业	735,604,618.91	5.18
酒店业	215,597,388.79	1.52
纺织服饰及奢侈品业	177,066,032.17	1.25
储蓄及抵押贷款	287,992,908.62	2.03
海洋业	392,414,245.87	2.76
航空业	89,595,284.11	0.63
产业融合业	63,416,042.08	0.45
化工业	226,595,723.49	1.59
化妆品制造业	183,778,837.82	1.29
计算机及辅助设备业	54,037,231.73	0.38
商业	69,071,723.29	0.49
容器及包装业	58,552,411.02	0.41
出口贸易	146,085,718.49	1.03
多元化电信服务业	130,492,491.26	0.92
制药业	70,793,166.00	0.50
特殊零售业	93,432,969.00	0.66
烟草业	107,630,081.73	0.76
公共交通设施业	98,347,175.02	0.69

合计	12,728,404,218.00	89.57
----	-------------------	-------

注：行业分类标准：MSCI

#### 5.4 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股票及存托凭证投资明细

序号	证券代码	公司名称 (英文)	公司名 称 (中 文)	所在 证 券市 场	所属国 家 (地 区)	数量 (股)	公允价值(人 民币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	939 HK	China Construction Bank Corp	中国建 设银行	香港 证券 交易 所	中国香 港	130,913,000	724,073,597.70	5.10
2	005930 KS	Samsung Electronics Co Ltd	三星电 子有限 公司	韩国 证券 交易 所	韩国	95,507	410,813,524.31	2.89
3	2628 HK	China Life Insurance Co Ltd	中国人 寿保险 股份有 限公司	香港 证券 交易 所	中国香 港	13,104,000	396,111,820.09	2.79
4	IDFC IN	Infrastructure Development Finance Ltd		印度 证券 交易 所	印度	14,957,000	391,896,032.63	2.76
5	BHP AU	BHP Billiton Ltd	必和必 拓有限 公司	澳大 利亚 证券	澳大利 亚	1,800,000	388,724,225.62	2.74

				交易 所				
6	UNTR IJ	PT United Tractors Tbk		印尼 证券 交易 所	印尼	25,453,500	357,526,557.70	2.52
7	883 HK	CNOOC Ltd	中国海 洋石油 有限公 司	香港 证券 交易 所	中国香 港	27,750,000	323,914,045.04	2.28
8	SCC-R TB	Siam Cement Public Co Ltd		泰国 证券 交易 所	泰国	5,582,000	306,624,964.26	2.16
9	105560 KS	KB Financial Group Inc		韩国 证券 交易 所	韩国	1,103,667	291,340,079.98	2.05
10	HDFC IN	Housing Development Finance Corp Ltd		印度 证券 交易 所	印度	669,000	287,992,908.62	2.03

#### 5.4.1 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券

#### 5.6 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

本基金本报告期末未持有债券

## 5.7 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

## 5.8 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金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例(%)
1	权证	Bank of Communication Co Ltd	5,103,481.50	0.04

## 5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	iShares MSCI Taiwan Webs Index Units	ETF	ETF	I shares Inc.	403,868,404.68	2.84

## 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调

查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	321,075,095.37
3	应收股利	65,862,645.80
4	应收利息	114,227.66
5	应收申购款	1,377,360.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	应收未起息外汇交易	90,073,891.04
9	其他	-
10	合计	478,503,220.82

#### 5.10.4 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

#### 5.10.5 报告期末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股票中不存在流通受限情况

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。