

**CICC-SZSE 100 INDEX TRACKER,
A SUB-FUND OF THE CICC INDEX TRUST**

中金深證 100 指數上市基金，
其為中金指數信託基金的一個子基金

Unaudited Interim Report

未經審核中期報告

For the period from 26th January 2010
(Date of Inception) to 30th June 2010

由二零一零年一月二十六日（成立日期）
至二零一零年六月三十日期間

CONTENTS

目錄

	<u>Page</u> <u>頁次</u>
Statement of Financial Position 財務狀況表	1
Statement of Comprehensive Income 全面收益表	2
Statement of Changes in Net Assets Attributable to Unitholders 單位持有人應佔資產淨值變動表	3
Statement of Distributions 分派表	4
Statement of Cash Flows 現金流量表	5
Investment Portfolio 投資組合	6
Statement of Movements in Portfolio Holdings 投資組合變動表	22
Performance Record 表現紀錄	23
Report on Investment Overweight 投資比重增加報告	24
Holdings of Collateral 抵押品持有狀況	25
Management and Administration 管理及行政	26

STATEMENT OF FINANCIAL POSITION (UNAUDITED)
財務狀況表 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

30th June 2010
二零一零年六月三十日
HKD
港元

ASSETS	資產	
Cash and cash equivalents	現金及現金等價物	8,825,386
Investments	投資	120,149,972
Dividend receivable	應收股息	138,691
Preliminary expenses	籌備開支	1,128,353
Total assets	總資產	130,242,402
LIABILITIES	負債	
Preliminary expenses payable	應付籌備開支	1,982,100
Other payables	其他應付款項	1,136,065
Total liabilities	總負債	3,118,165
TOTAL NET ASSETS	淨資產總值	127,124,237
EQUITY	權益	
Capital attributable to unitholders	單位持有人應佔資本	127,124,237
TOTAL EQUITY	總權益	127,124,237
Supplementary information:	補充資料：	
NET ASSETS ATTRIBUTABLE TO UNITHOLDERS (AT BID MARKET PRICES)	單位持有人應佔資產淨值 (按買入市價計算)	127,124,237
Adjustments from bid market prices to last traded market prices	由買入市價調整至最後成交市價	77,291
NET ASSETS ATTRIBUTABLE TO UNITHOLDERS (AT LAST TRADED MARKET PRICES)	單位持有人應佔資產淨值 (按最後成交市價計算)	127,201,528
Number of units outstanding	已發行單位數目	4,250,000
Net asset value per unit	每單位資產淨值	29.9298

STATEMENT OF COMPREHENSIVE INCOME (UNAUDITED)
全面收益表 (未經審核)

for the period from 26th January 2010
(Date of inception) to 30th June 2010
自二零一零年一月二十六日 (成立日期)
起至二零一零年六月三十日期間

		Period from 26th Jan 2010 (Date of inception) to 30th June 2010 自二零一零年 一月二十六日 (成立日期) 起至二零一零年 六月三十日期間 HKD 港元
Dividend income	股息收入	700,332
Net loss on investments	投資虧損淨額	(35,630,592)
Net foreign exchange loss	外匯虧損淨額	(484)
NET INVESTMENT LOSS	投資虧損淨額	(34,930,744)
Management fees	管理費	651,703
Trustee's fees	受託人費用	363,548
Auditor's remuneration	核數師酬金	137,647
Preliminary expenses	籌備開支	956,647
Safe custody and bank charges	託管費及銀行手續費	16,622
Transaction fees	交易費用	105,914
Other fees	其他費用	1,473,563
OPERATING EXPENSES	營運開支	3,705,644
Change in net assets attributable to unitholders	單位持有人應佔資產淨值變動	(38,636,388)

**STATEMENT OF CHANGES IN NET ASSETS
ATTRIBUTABLE TO UNITHOLDERS (UNAUDITED)
單位持有人應佔資產淨值變動表 (未經審核)**

for the period from 26th January 2010
(Date of inception) to 30th June 2010
自二零一零年一月二十六日 (成立日期)
起至二零一零年六月三十日期間

**Period from
26th Jan 2010
(Date of inception)
to 30th June 2010
自二零一零年
一月二十六日 (成立日期)
起至二零一零年
六月三十日期間
HKD
港元**

Subscriptions received from units issued	已發行單位的已收認購款項	
– in-kind	– 實物方式	155,780,564
– cash component	– 現金成分	9,980,061
		165,760,625
Change in net assets attributable to unitholders	單位持有人應佔資產淨值的變動	(38,636,388)
Net assets attributable to unitholders, beginning of period	期初單位持有人應佔資產淨值	–
Net assets attributable to unitholders, end of period	期末單位持有人應佔資產淨值	127,124,237

STATEMENT OF DISTRIBUTIONS (UNAUDITED)
分派表 (未經審核)

for the period from 26th January 2010
(Date of inception) to 30th June 2010
自二零一零年一月二十六日 (成立日期)
起至二零一零年六月三十日期間

Period from
26th Jan 2010
(Date of inception)
to 30th June 2010
自二零一零年
一月二十六日 (成立日期)
起至二零一零年
六月三十日期間
HKD
港元

Amount transferred from statement of changes in net assets attributable to unitholders	自單位持有人應佔資產 淨值變動表轉撥的金額	—
Distribution	分派	—
		—
		—

STATEMENT OF CASH FLOWS (UNAUDITED)
現金流量表 (未經審核)

for the period from 26th January 2010
(Date of inception) to 30th June 2010
自二零一零年一月二十六日 (成立日期)
起至二零一零年六月三十日期間

Period from
26th Jan 2010
(Date of inception)
to 30th June 2010
自二零一零年
一月二十六日 (成立日期)
起至二零一零年
六月三十日期間
HKD
港元

OPERATING ACTIVITIES	營運活動	
Dividend received	已收股息	561,641
Preliminary expenses paid	已付籌備開支	(102,900)
Management fees paid	已付管理費	(539,934)
Transaction cost paid	已付交易成本	(87,619)
Other operating expenses paid	其他已付營運開支	(985,863)
Cash flows used in operating activities	用於營運活動的現金流量	(1,154,675)
INVESTING ACTIVITIES	投資活動	
Purchase of investments	購買投資	(155,780,564)
Cash flows used in investing activities	用於投資活動的現金流量	(155,780,564)
FINANCING ACTIVITIES	融資活動	
Proceeds from issue of units	發行單位所得款項	165,760,625
Cash flows generated from financing activities	融資活動產生的現金流量	165,760,625
Net increase in cash and cash equivalents	現金及現金等價物增加淨額	8,825,386
Cash and cash equivalents at beginning of period	期初的現金及現金等價物	—
Cash and cash equivalents at end of period	期末的現金及現金等價物	8,825,386

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%)	投資 (94.46%)				
CHINA (94.46%)	中國 (94.46%)				
BASE SECURITIES ISSUED BY CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (5.56%)	由 CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. 發行的基礎證券， 以下列相關上市股票追蹤 (5.56%)				
ADVANCED TECHNOLOGY & MATERIALS CO LTD	安泰科技股份有限公司	2,880	21/01/2014	48,430	0.04
ANGANG STEEL CO LTD	鞍鋼股份有限公司	8,800	20/01/2015	72,619	0.06
ANHUI BBKA BIOCHEMICAL CO LTD	安徽豐原生物化學股份有限公司	5,200	20/01/2015	40,887	0.03
BANK OF NINGBO CO LTD	寧波銀行股份有限公司	7,200	21/01/2014	90,805	0.07
BEIJING SHOUGANG CO LTD	北京首鋼股份有限公司	7,400	20/01/2015	26,500	0.02
BEIJING YANJING BREWERY CO	北京燕京啤酒股份有限公司	3,400	20/01/2015	77,026	0.06
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	長江證券有限責任公司	7,600	21/01/2014	94,075	0.07
CHANGSHA ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	長沙中聯重工業科技 發展股份有限公司	5,600	20/01/2015	104,196	0.08
CHENZHOU MINING GROUP CO	辰州礦業股份有限公司	2,000	21/01/2014	39,393	0.03
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	中國寶安集團股份有限公司	6,200	21/01/2014	60,817	0.05
CHINA CIFCO INVESTMENT CO LTD	中國中期投資股份有限公司	1,000	21/01/2014	30,595	0.02
CHINA INTL MARINE CONTAINERS (GRP) CO LTD	中國國際海運集裝箱 (集團) 股份有限公司	5,400	20/01/2015	73,569	0.06
CHINA MERCHANTS PROPERTY DEV	招商局地產控股股份有限公司	4,400	21/01/2014	75,017	0.06
CHINA NONFERROUS METAL IND	中國有色金屬建設	2,400	21/01/2014	32,511	0.03
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL AND PHARMACEUTICAL CO LTD	華潤三九醫藥股份有限公司	2,200	21/01/2014	57,890	0.05
CHINA VANKE CO LTD	萬科企業股份有限公司	55,400	20/01/2015	431,295	0.34
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	重慶長安汽車股份有限公司	4,400	20/01/2015	43,846	0.03
CITIC GUOAN INFORMATION INDUSTRY CO	中信國安信息產業股份有限公司	6,000	20/01/2015	75,671	0.06
COFCO PROPERTY (GROUP) CO LTD	中糧地產 (集團) 股份有限公司	6,000	21/01/2014	47,178	0.04

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具 (包括 (但不限於) 認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (5.56%) (CONTINUED)	由 CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. 發行的基礎證券， 以下列相關上市股票追蹤 (5.56%) (續)				
CSG HOLDING CO LTD	中國南玻集團股份有限公司	5,100	21/01/2014	53,600	0.04
FAW CAR CO LTD	一汽轎車股份有限公司	5,200	21/01/2014	89,466	0.07
FINANCE STREET HOLDING CO LTD	金融街控股股份有限公司	12,400	17/01/2012	117,773	0.09
FOSHAN ELECTRICAL & LIGHT CO LTD	佛山電器照明股份有限公司	3,400	21/01/2014	46,321	0.04
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	珠海格力電器股份有限公司	8,600	17/01/2012	185,457	0.15
GUANGDONG BAOLIHUA NEW ENERGY STOCK CO LTD	廣東寶麗華新能源股份有限公司	7,200	21/01/2014	41,479	0.03
GUANGDONG ELECTRIC POWER DEV CO LTD	廣東電力發展股份有限公司	4,600	20/01/2015	34,021	0.03
GUANGXI LIUGONG MACHINERY	廣西柳工機械股份有限公司	2,600	17/01/2012	54,854	0.04
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	國元證券有限責任公司	5,400	21/01/2014	74,830	0.06
HAN'S LASER TECHNOLOGY CO LTD	大族激光科技股份有限公司	3,000	21/01/2014	38,069	0.03
HEBEI IRON & STEEL CO LTD	河北鋼鐵集團有限公司	25,200	21/01/2014	107,901	0.09
HENAN SHEN HUO COAL INDUSTRY & ELECTRICITY POWER CO LTD	河南神火煤電股份有限公司	3,640	17/01/2012	69,711	0.05
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	河南雙匯投資發展股份有限公司	2,000	20/01/2015	115,531	0.09
HONG YUAN SECURITIES CO LTD	宏遠證券股份有限公司	3,400	17/01/2012	56,909	0.04
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	華蘭生物工程股份有限公司	1,920	21/01/2014	99,101	0.08
HUAWEN MEDIA INVESTMENT CORPORATION	華聞傳媒投資集團股份有限公司	5,400	21/01/2014	31,530	0.02
HUBEI GUANGJI PHARMACEUTICAL CO LTD	湖北廣濟藥業股份有限公司	1,400	21/01/2014	14,387	0.01
HUBEI YIHUA CHEMICAL INDUSTRY CO LTD	湖北宜化化工股份有限公司	3,000	21/01/2014	43,674	0.03
HUNAN TV & BROADCAST INTERMEDIARY CO LTD	湖南電廣傳媒股份有限公司	2,000	21/01/2014	35,656	0.03

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具 (包括 (但不限於) 認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV
		持股量	基礎證券到期日	市值 港元	佔資產淨值 百分比 (%)
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (5.56%) (CONTINUED)	由 CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. 發行的基礎證券，以下列相關上市股票追蹤 (5.56%) (續)				
HUNAN VALIN STEEL AND WIRE CO LTD	湖南華菱管線股份有限公司	6,200	20/01/2015	26,547	0.02
HUOLINHE OPENCUT COAL INDUSTRY CORPORATION LTD	內蒙古霍林河露天煤業股份有限公司	1,440	21/01/2014	28,138	0.02
JIANGLING MOTORS CORP LTD	江鈴汽車股份有限公司	1,000	21/01/2014	20,631	0.02
JIANGSU WUJIANG CHINA EASTERN SILK MARKET CO LTD	江蘇吳江中國東方絲綢市場股份有限公司	5,200	21/01/2014	27,933	0.02
JIAOZUO WANFANG ALUMINUM MANUFACTURING CO LTD	焦作萬方鋁業股份有限公司	1,800	21/01/2014	34,893	0.03
JILIN AODONG MEDICINE INDUSTRY GROUPS CO LTD	吉林敖東藥業集團股份有限公司	3,200	17/01/2012	97,407	0.08
JIZHONG ENERGY RESOURCES CO LTD	冀中能源股份有限公司	2,200	17/01/2012	56,006	0.04
LEAGUER STOCK CO LTD	力合股份有限公司	1,800	21/01/2014	14,854	0.01
LIAONING HUAJIN TONGDA CHEMICALS CO LTD	遼寧華錦通達化工股份有限公司	4,000	20/01/2015	35,500	0.03
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	瀘州老窖股份有限公司	4,400	17/01/2012	142,156	0.11
MILORD REAL ESTATE DEVELOPMENT GROUP CO LTD	名流置業集團股份有限公司	11,020	21/01/2014	39,464	0.03
NORTHEAST PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	東北制藥集團股份有限公司	1,000	21/01/2014	17,361	0.01
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	東北證券股份有限公司	1,200	21/01/2014	31,857	0.03
OCEANWIDE CONSTRUCTION GROUP CO LTD	泛海建設集團股份有限公司	3,000	21/01/2014	27,559	0.02
QINGHAI SALT LAKE POTASH	青海鹽湖鉀肥股份有限公司	2,600	20/01/2015	116,185	0.09
SEARAINBOW HOLDING CORP	海虹企業(控股)股份有限公司	3,800	21/01/2014	36,388	0.03
SGIS SONGSHAN CO LTD	廣東韶鋼松山股份有限公司	7,200	17/01/2012	29,147	0.02
SHANDONG CHENMING PAPER HLDGS LTD	山東晨鳴紙業集團股份有限公司	5,400	20/01/2015	39,938	0.03
SHANDONG DONG-E E-JIAO CO LTD	山東東阿阿膠股份有限公司	3,400	17/01/2012	134,994	0.11
SHANDONG HAIHUA CO LTD	山東海化股份有限公司	3,600	21/01/2014	21,300	0.02

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具(包括(但不限於)認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (5.56%) (CONTINUED)	由 CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. 發行的基礎證券， 以下列相關上市股票追蹤 (5.56%) (續)				
SHANDONG JINLING MINING CO LTD	山東金嶺礦業股份有限公司	1,600	21/01/2014	23,667	0.02
SHANGHAI KEHUA BIO-ENGINEERING CO	上海科華生物工程股份有限公司	2,400	21/01/2014	40,358	0.03
SHANGHAI SIYUAN ELECTIC CO LTD	上海思源電氣股份有限公司	1,600	21/01/2014	46,586	0.04
SHANTUI CONSTRUCTION MACHINE CO LTD	山推工程機械股份有限公司	4,000	21/01/2014	50,136	0.04
SHANXI TAIGANG STAINLESS	山西太鋼不鏽鋼股份有限公司	14,000	20/01/2015	81,744	0.06
SHANXI XISHAN COAL & ELEC POWER CO LTD	山西西山煤電股份有限公司	9,880	20/01/2015	205,368	0.16
SHENYANG INGENIOUS DEVELOPMENT CO	瀋陽銀基發展股份有限公司	6,200	21/01/2014	26,065	0.02
SHENZHEN AGRICULTURAL PRODUCTS CO	深圳農產品股份有限公司	3,200	17/01/2012	58,046	0.05
SHENZHEN AIRPORT CO LTD	深圳機場股份有限公司	4,400	20/01/2015	26,376	0.02
SHENZHEN DEVELOPMENT BANK CO LTD	深圳發展銀行股份有限公司	17,800	20/01/2015	357,523	0.28
SHENZHEN ENERGY INVESTMENT CO LTD	深圳能源投資股份有限公司	4,000	20/01/2015	43,597	0.03
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	深圳開發科技股份有限公司	3,600	21/01/2014	43,721	0.03
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN HOLDINGS CO LTD	深圳華僑城股份有限公司	8,800	20/01/2015	110,984	0.09
SHENZHEN ZHENYE (GROUP) CO LTD	深圳振業(集團)股份有限公司	3,900	21/01/2014	23,075	0.02
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN NONFEMET CO LTD	深圳中金嶺南有色金屬股份有限公司	6,510	20/01/2015	96,294	0.08
SICHUAN NEW HOPE AGRIBUSINESS CO LTD	四川新希望農業股份有限公司	2,400	21/01/2014	23,355	0.02
SUNING APPLIANCE CO LTD	蘇寧電器股份有限公司	25,800	20/01/2015	337,437	0.27
SUNING UNIVERSAL CO LTD	蘇寧環球股份有限公司	4,000	21/01/2014	39,548	0.03
TAIYUAN COAL GASIFICATION CO LTD	太原煤炭氣化有限公司	1,600	21/01/2014	24,912	0.02

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具(包括(但不限於)認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (5.56%) (CONTINUED)	由 CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. 發行的基礎證券， 以下列相關上市股票追蹤 (5.56%) (續)				
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO. LTD.	唐山冀東水泥股份有限公司	4,200	20/01/2015	71,607	0.06
TCL CORPORATION	TCL 集團股份有限公司	13,600	20/01/2015	58,233	0.05
TIANJIN JINBIN DEVELOPMENT CO LTD	天津津濱發展股份有限公司	8,400	21/01/2014	38,583	0.03
TIANJIN TEDA CO LTD	天津泰達股份有限公司	6,600	21/01/2014	53,437	0.04
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	銅陵有色金屬集團控股有限公司	3,800	20/01/2015	63,013	0.05
WEICHAJ POWER CO LTD	濰柴動力股份有限公司	1,800	17/01/2012	126,819	0.10
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY CO LTD	威孚高科技股份有限公司	2,400	17/01/2012	37,368	0.03
WULIANGYE YIBIN CO LTD	宜賓五糧液股份有限公司	11,400	20/01/2015	315,951	0.25
XI'AN AIRCRAFT INTERNATIONAL CORP	西安飛機國際航空製造股份有限公司	7,200	21/01/2014	80,716	0.06
XIANDAI INVESTMENT CO LTD	現代投資股份有限公司	1,800	21/01/2014	34,472	0.03
XINJIANG GOLDWIND SCI & TECH CO LTD	新疆金風科技股份有限公司	6,720	21/01/2014	119,803	0.09
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD	新疆中泰化學股份有限公司	2,000	21/01/2014	39,704	0.03
XINXING DUCTILE IRON PIPES	新興鑄管股份有限公司	6,500	20/01/2015	46,555	0.04
XJ ELECTRIC CO LTD	許繼電氣股份有限公司	1,800	21/01/2014	54,231	0.04
YANTAI CHANGYU PIONEER WINE CO LTD	煙台張裕葡萄酒股份有限公司	400	20/01/2015	36,621	0.03
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	雲南鋁業股份有限公司	3,600	21/01/2014	32,230	0.03
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	雲南白藥集團股份有限公司	1,200	17/01/2012	88,657	0.07
YUNNAN COPPER INDUSTRY CO LTD	雲南銅業(集團)有限公司	3,800	17/01/2012	77,804	0.06
ZHEJIANG NHU CO LTD	浙江新合成股份有限公司	1,040	21/01/2014	30,524	0.02
ZTE CORPORATION	中興通訊股份有限公司	8,700	20/01/2015	191,677	0.15
				<u>7,067,645</u>	<u>5.56</u>

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤 A 股表現的金融衍生工具 (包括 (但不限於) 認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V., LONDON BRANCH TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (50.01%)	由 ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V. 倫敦分行發行的基礎證券，以下列相關上市股票追蹤 (50.01%)				
ADVANCED TECHNOLOGY & MATERIALS CO LTD	安泰科技股份有限公司	25,920	30/06/2011	435,866	0.34
ANGANG STEEL CO LTD	鞍鋼股份有限公司	79,200	30/06/2011	653,575	0.51
ANHUI BBKA BIOCHEMICAL CO LTD	安徽豐原生物化學股份有限公司	46,800	30/06/2011	367,986	0.29
BANK OF NINGBO CO LTD	寧波銀行股份有限公司	64,800	30/06/2011	817,249	0.64
BEIJING SHOUGANG CO LTD	北京首鋼股份有限公司	66,600	30/06/2011	238,504	0.19
BEIJING YANJING BREWERY CO	北京燕京啤酒股份有限公司	30,600	30/06/2011	693,232	0.54
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	長江證券有限責任公司	68,400	30/06/2011	846,676	0.67
CHANGSHA ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY & DEVELOPMENT CO LTD	長沙中聯重工工業科技發展股份有限公司	50,400	30/06/2011	937,762	0.74
CHENZHOU MINING GROUP CO	辰州礦業股份有限公司	18,000	30/06/2011	354,533	0.28
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	中國寶安集團股份有限公司	55,800	30/06/2011	547,355	0.43
CHINA CIFCO INVESTMENT CO LTD	中國中期投資股份有限公司	9,000	30/06/2011	275,359	0.22
CHINA INTL MARINE CONTAINERS(GRP) CO LTD	中國國際海運集裝箱 (集團) 股份有限公司	48,600	30/06/2011	662,123	0.52
CHINA MERCHANTS PROPERTY DEV	招商局地產控股股份有限公司	39,600	30/06/2011	675,155	0.53
CHINA NONFERROUS METAL IND	中國有色金屬建設	21,600	30/06/2011	292,595	0.23
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL AND PHARMACEUTICAL CO LTD	華潤三九醫藥股份有限公司	19,800	30/06/2011	521,010	0.41
CHINA VANKE CO LTD	萬科企業股份有限公司	498,600	30/06/2011	3,881,651	3.05
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	重慶長安汽車股份有限公司	39,600	30/06/2011	394,611	0.31
CITIC GUOAN INFORMATION INDUSTRY CO	中信國安信息產業股份有限公司	54,000	30/06/2011	681,041	0.54
COFCO PROPERTY (GROUP) CO LTD	中糧地產 (集團) 股份有限公司	54,000	30/06/2011	424,599	0.33

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具 (包括 (但不限於) 認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V., LONDON BRANCH TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (50.01%) (CONTINUED)	由 ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V. 倫敦分行發行的基礎證券，以下列相關上市股票追蹤 (50.01%) (續)				
CSG HOLDING CO LTD	中國南玻集團股份有限公司	45,900	30/06/2011	482,404	0.38
FAW CAR CO LTD	一汽轎車股份有限公司	46,800	30/06/2011	805,197	0.63
FINANCE STREET HOLDING CO LTD	金融街控股股份有限公司	111,600	30/06/2011	1,059,957	0.83
FOSHAN ELECTRICAL & LIGHT CO LTD	佛山電器照明股份有限公司	30,600	30/06/2011	416,892	0.33
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	珠海格力電器股份有限公司	77,400	30/06/2011	1,669,110	1.31
GUANGDONG BAOLIHUA NEW ENERGY STOCK CO LTD	廣東寶麗華新能源股份有限公司	64,800	30/06/2011	373,311	0.29
GUANGDONG ELECTRIC POWER DEV CO LTD	廣東電力發展股份有限公司	41,400	30/06/2011	306,188	0.24
GUANGXI LIUGONG MACHINERY	廣西柳工機械股份有限公司	23,400	30/06/2011	493,684	0.39
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	國元證券有限責任公司	48,600	30/06/2011	673,473	0.53
HAN'S LASER TECHNOLOGY CO LTD	大族激光科技股份有限公司	27,000	30/06/2011	342,622	0.27
HEBEI IRON & STEEL CO LTD	河北鋼鐵集團有限公司	226,800	30/06/2011	971,113	0.76
HENAN SHEN HUO COAL INDUSTRY & ELECTRICITY POWER CO LTD	河南神火煤電股份有限公司	32,760	30/06/2011	627,398	0.49
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	河南雙匯投資發展股份有限公司	18,000	30/06/2011	1,039,778	0.82
HONG YUAN SECURITIES CO LTD	宏遠證券股份有限公司	30,600	30/06/2011	512,182	0.40
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING	華蘭生物工程股份有限公司	17,280	30/06/2011	891,911	0.70
HUAWEN MEDIA INVESTMENT INC CORPORATION	華聞傳媒投資集團股份有限公司	48,600	30/06/2011	283,767	0.22
HUBEI GUANGJI PHARMACEUTICAL CO LTD	湖北廣濟藥業股份有限公司	12,600	30/06/2011	129,482	0.10
HUBEI YIHUA CHEMICAL INDUSTRY CO LTD	湖北宜化化工股份有限公司	27,000	30/06/2011	393,070	0.31
HUNAN TV & BROADCAST INTERMEDIARY CO LTD	湖南電廣傳媒股份有限公司	18,000	30/06/2011	320,902	0.25

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券－為追蹤A股表現的金融衍生工具 (包括 (但不限於) 認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合(未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV
		持股量	基礎證券到期日	市值 港元	佔資產淨值 百分比 (%)
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資(94.46%)(續)				
CHINA (94.46%%) (CONTINUED)	中國(94.46%)(續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V., LONDON BRANCH TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (50.01%) (CONTINUED)	由 ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V. 倫敦分行發行的基礎證券，以下列相關上市股票追蹤(50.01%)(續)				
HUNAN VALIN STEEL AND WIRE CO LTD	湖南華菱管線股份有限公司	55,800	30/06/2011	238,925	0.19
HUOLINHE OPENCUT COAL INDUSTRY CORPORATION LTD	內蒙古霍林河露天煤業股份有限公司	12,960	30/06/2011	253,246	0.20
JIANGLING MOTORS CORP LTD	江鈴汽車股份有限公司	9,000	30/06/2011	185,675	0.15
JIANGSU WUJIANG CHINA EASTERN SILK MARKET CO LTD	江蘇吳江中國東方絲綢市場股份有限公司	46,800	30/06/2011	251,396	0.20
JIAOZUO WANFANG ALUMIMUM MANUFACTURING CO LTD	焦作萬方鋁業股份有限公司	16,200	30/06/2011	314,035	0.25
JILIN AODONG MEDICINE INDUSTRY GROUPS CO LTD	吉林敖東藥業集團股份有限公司	28,800	30/06/2011	876,665	0.69
JIZHONG ENERGY RESOURCES CO LTD	冀中能源股份有限公司	19,800	30/06/2011	504,054	0.40
LEAGUER STOCK CO LTD	力合股份有限公司	16,200	30/06/2011	133,686	0.10
LIAONING HUAJIN TONGDA CHEMICALS CO LTD	遼寧華錦通達化工股份有限公司	36,000	30/06/2011	319,501	0.25
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	瀘州老窖股份有限公司	39,600	30/06/2011	1,279,403	1.01
MILORD REAL ESTATE DEVELOPMENT GROUP CO LTD	名流置業集團股份有限公司	99,180	30/06/2011	355,178	0.28
NORTHEAST PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	東北制藥集團股份有限公司	9,000	30/06/2011	156,247	0.12
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	東北證券股份有限公司	10,800	30/06/2011	286,710	0.23
OCEANWIDE CONSTRUCTION GROUP CO LTD	泛海建設集團股份有限公司	27,000	30/06/2011	248,033	0.19
QINGHAI SALT LAKE POTASH	青海鹽湖鉀肥股份有限公司	23,400	30/06/2011	1,045,664	0.82
SEARAINBOW HOLDING CORP	海虹企業(控股)股份有限公司	34,200	30/06/2011	327,488	0.26
SGIS SONGSHAN CO LTD	廣東韶鋼松山股份有限公司	64,800	30/06/2011	262,327	0.21
SHANDONG CHENMING PAPER HLDGS LTD	山東晨鳴紙業集團股份有限公司	48,600	30/06/2011	359,438	0.28
SHANDONG DONG-E E-JIAO CO LTD	山東東阿阿膠股份有限公司	30,600	30/06/2011	1,214,943	0.95
SHANDONG HAIHUA CO LTD	山東海化股份有限公司	32,400	30/06/2011	191,700	0.15

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具(包括(但不限於)認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V., LONDON BRANCH TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (50.01%) (CONTINUED)	由 ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V. 倫敦分行發行的基礎證券，以下列相關上市股票追蹤 (50.01%) (續)				
SHANDONG JINLING MINING CO LTD	山東金嶺礦業股份有限公司	14,400	30/06/2011	213,000	0.17
SHANGHAI KEHUA BIO-ENGINEERING CO	上海科華生物工程股份有限公司	21,600	30/06/2011	363,222	0.29
SHANGHAI SIYUAN ELECTIC CO LTD	上海思源電氣股份有限公司	14,400	30/06/2011	419,274	0.33
SHANTUI CONSTRUCTION MACHINE CO LTD	山推工程機械股份有限公司	36,000	30/06/2011	451,224	0.35
SHANXI TAIGANG STAINLESS	山西太鋼不鏽鋼股份有限公司	126,000	30/06/2011	735,692	0.58
SHANXI XISHAN COAL & ELEC POWER CO LTD	山西西山煤電股份有限公司	88,920	30/06/2011	1,848,310	1.45
SHENYANG INGENIOUS DEVELOPMENT CO	瀋陽銀基發展股份有限公司	55,800	30/06/2011	234,581	0.18
SHENZHEN AGRICULTURAL PRODUCTS CO	深圳農產品股份有限公司	28,800	30/06/2011	522,411	0.41
SHENZHEN AIRPORT CO LTD	深圳機場股份有限公司	39,600	30/06/2011	237,383	0.19
SHENZHEN DEVELOPMENT BANK CO LTD	深圳發展銀行股份有限公司	160,200	30/06/2011	3,217,706	2.53
SHENZHEN ENERGY INVESTMENT CO LTD	深圳能源投資股份有限公司	36,000	30/06/2011	392,369	0.31
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	深圳開發科技股份有限公司	32,400	30/06/2011	393,490	0.31
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN HOLDINGS CO LTD	深圳華僑城股份有限公司	79,200	30/06/2011	998,860	0.79
SHENZHEN ZHENYE (GROUP) CO LTD	深圳振業(集團)股份有限公司	35,100	30/06/2011	207,675	0.16
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN NONFEMET CO LTD	深圳中金嶺南有色金屬股份有限公司	58,590	30/06/2011	866,645	0.68
SICHUAN NEW HOPE AGRIBUSINESS CO LTD	四川新希望農業股份有限公司	21,600	30/06/2011	210,198	0.16
SUNING APPLIANCE CO LTD	蘇寧電器股份有限公司	232,200	30/06/2011	3,036,936	2.39
SUNING UNIVERSAL CO LTD	蘇寧環球股份有限公司	36,000	30/06/2011	355,935	0.28
TAIYUAN COAL GASIFICATION CO LTD	太原煤炭氣化有限公司	14,400	30/06/2011	224,211	0.18

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具(包括(但不限於)認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V., LONDON BRANCH TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (50.01%) (CONTINUED)	由 ROYAL BANK OF SCOTLAND N.V. 倫敦分行發行的基礎證券，以下列相關上市股票追蹤 (50.01%) (續)				
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO. LTD.	唐山冀東水泥股份有限公司	37,800	30/06/2011	644,466	0.51
TCL CORPORATION	TCL 集團股份有限公司	122,400	30/06/2011	524,093	0.41
TIANJIN JINBIN DEVELOPMENT CO LTD	天津津濱發展股份有限公司	75,600	30/06/2011	347,247	0.27
TIANJIN TEDA CO LTD	天津泰達股份有限公司	59,400	30/06/2011	480,932	0.38
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	銅陵有色金屬集團控股有限公司	34,200	30/06/2011	567,113	0.45
WEICHAI POWER CO LTD	濰柴動力股份有限公司	16,200	30/06/2011	1,141,374	0.90
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY CO LTD	威孚高科技股份有限公司	21,600	30/06/2011	336,316	0.26
WULIANGYE YIBIN CO LTD	宜賓五糧液股份有限公司	102,600	30/06/2011	2,843,555	2.24
XI'AN AIRCRAFT INTERNATIONAL CORP	西安飛機國際航空製造股份有限公司	64,800	30/06/2011	726,443	0.57
XIANDAI INVESTMENT CO LTD	現代投資股份有限公司	16,200	30/06/2011	310,252	0.24
XINJIANG GOLDWIND SCI & TECH CO LTD	新疆金風科技股份有限公司	60,480	30/06/2011	1,078,230	0.85
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD	新疆中泰化學股份有限公司	18,000	30/06/2011	357,336	0.28
XINXING DUCTILE IRON PIPES	新興鑄管股份有限公司	58,500	30/06/2011	418,994	0.33
XJ ELECTRIC CO LTD	許繼電氣股份有限公司	16,200	30/06/2011	488,079	0.38
YANTAI CHANGYU PIONEER WINE CO LTD	煙台張裕葡萄酒股份有限公司	3,600	30/06/2011	329,590	0.26
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	雲南鋁業股份有限公司	32,400	30/06/2011	290,073	0.23
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	雲南白藥集團股份有限公司	10,800	30/06/2011	797,911	0.63
YUNNAN COPPER INDUSTRY CO LTD	雲南銅業(集團)有限公司	34,200	30/06/2011	700,239	0.55
ZHEJIANG NHU CO LTD	浙江新合成股份有限公司	9,360	30/06/2011	274,714	0.22
ZTE CORPORATION	中興通訊股份有限公司	78,300	30/06/2011	1,725,093	1.36
				<u>63,608,809</u>	<u>50.01</u>

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券－為追蹤 A 股表現的金融衍生工具 (包括 (但不限於) 認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	佔資產 淨值 百分比 (%)
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY UBS AG TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (38.89%)	由 UBS AG 發行的基礎證券， 以下列相關上市股票追蹤 (38.89%)				
ADVANCED TECHNOLOGY & MATERIALS CO LTD	安泰科技股份有限公司	20,160	22/01/2015	339,007	0.27
ANGANG STEEL CO LTD	鞍鋼股份有限公司	61,600	22/01/2015	508,336	0.40
ANHUI BBKA BIOCHEMICAL CO LTD	安徽豐原生物化學股份有限公司	36,400	22/01/2015	286,211	0.22
BANK OF NINGBO CO LTD	寧波銀行股份有限公司	50,400	22/01/2015	635,638	0.50
BEIJING SHOUGANG CO LTD	北京首鋼股份有限公司	51,800	22/01/2015	185,503	0.15
BEIJING YANJING BREWERY CO	北京燕京啤酒股份有限公司	23,800	22/01/2015	539,181	0.42
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	長江證券有限責任公司	53,200	22/01/2015	658,526	0.52
CHANGSHA ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	長沙中聯重工工業科技發展股份有限公司	39,200	22/01/2015	729,370	0.57
CHENZHOU MINING GROUP CO	辰州礦業股份有限公司	14,000	22/01/2015	275,748	0.22
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	中國寶安集團股份有限公司	43,400	22/01/2015	425,720	0.33
CHINA CIFCO INVESTMENT CO LTD	中國中期投資股份有限公司	7,000	22/01/2015	214,168	0.17
CHINA INTL MARINE CONTAINERS(GRP) CO LTD	中國國際海運集裝箱(集團)股份有限公司	37,800	22/01/2015	514,984	0.40
CHINA MERCHANTS PROPERTY DEV	招商局地產控股股份有限公司	30,800	22/01/2015	525,121	0.41
CHINA NONFERROUS METAL IND	中國有色金屬建設	16,800	22/01/2015	227,574	0.18
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL AND PHARMACEUTICAL CO LTD	華潤三九醫藥股份有限公司	15,400	22/01/2015	405,230	0.32
CHINA VANKE CO LTD	萬科企業股份有限公司	387,800	22/01/2015	3,019,062	2.37
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	重慶長安汽車股份有限公司	30,800	22/01/2015	306,920	0.24
CITIC GUOAN INFORMATION INDUSTRY CO	中信國安信息產業股份有限公司	42,000	22/01/2015	529,698	0.42
COFCO PROPERTY (GROUP) CO LTD	中糧地產(集團)股份有限公司	42,000	22/01/2015	330,244	0.26

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具(包括(但不限於)認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV
		持股量	基礎證券到期日	市值 港元	佔資產淨值 百分比 (%)
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY UBS AG TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (38.89%) (CONTINUED)	由 UBS AG 發行的基礎證券，以下列相關上市股票追蹤 (38.89%) (續)				
CSG HOLDING CO LTD	中國南玻集團股份有限公司	35,700	22/01/2015	375,203	0.29
FAW CAR CO LTD	一汽轎車股份有限公司	36,400	22/01/2015	626,265	0.49
FINANCE STREET HOLDING CO LTD	金融街控股股份有限公司	86,800	22/01/2015	824,411	0.65
FOSHAN ELECTRICAL & LIGHT CO LTD	佛山電器照明股份有限公司	23,800	22/01/2015	324,249	0.25
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	珠海格力電器股份有限公司	60,200	22/01/2015	1,298,197	1.02
GUANGDONG BAOLIHUA NEW ENERGY STOCK CO LTD	廣東寶麗華新能源股份有限公司	50,400	22/01/2015	290,353	0.23
GUANGDONG ELECTRIC POWER DEV CO LTD	廣東電力發展股份有限公司	32,200	22/01/2015	238,146	0.19
GUANGXI LIUGONG MACHINERY	廣西柳工機械股份有限公司	18,200	22/01/2015	383,977	0.30
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	國元證券有限責任公司	37,800	22/01/2015	523,813	0.41
HAN'S LASER TECHNOLOGY CO LTD	大族激光科技股份有限公司	21,000	22/01/2015	266,484	0.21
HEBEI IRON & STEEL CO LTD	河北鋼鐵集團有限公司	176,400	22/01/2015	755,310	0.59
HENAN SHEN HUO COAL INDUSTRY & ELECTRICITY POWER CO LTD	河南神火煤電股份有限公司	25,480	22/01/2015	487,976	0.38
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	河南雙匯投資發展股份有限公司	14,000	22/01/2015	808,716	0.64
HONG YUAN SECURITIES CO LTD	宏遠證券股份有限公司	23,800	22/01/2015	398,364	0.31
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	華蘭生物工程股份有限公司	13,440	22/01/2015	693,708	0.55
HUAWEN MEDIA INVESTMENT CORPORATION	華聞傳媒投資集團股份有限公司	37,800	22/01/2015	220,708	0.17
HUBEI GUANGJI PHARMACEUTICAL CO LTD	湖北廣濟藥業股份有限公司	9,800	22/01/2015	100,708	0.08
HUBEI YIHUA CHEMICAL INDUSTRY CO LTD	湖北宜化化工股份有限公司	21,000	22/01/2015	305,721	0.24
HUNAN TV & BROADCAST INTERMEDIARY CO LTD	湖南電廣傳媒股份有限公司	14,000	22/01/2015	249,590	0.20

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券－為追蹤 A 股表現的金融衍生工具 (包括 (但不限於) 認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY UBS AG TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (38.89%) (CONTINUED)	由 UBS AG 發行的基礎證券， 以下列相關上市股票 追蹤 (38.89%) (續)				
HUNAN VALIN STEEL AND WIRE CO LTD	湖南華菱管線股份有限公司	43,400	22/01/2015	185,830	0.15
HUOLINHE OPENCUT COAL INDUSTRY CORPORATION LTD	內蒙古霍林河露天煤業股份有限公司	10,080	22/01/2015	196,969	0.15
JIANGLING MOTORS CORP LTD	江鈴汽車股份有限公司	7,000	22/01/2015	144,414	0.11
JIANGSU WUJIANG CHINA EASTERN SILK MARKET CO LTD	江蘇吳江中國東方絲綢市場股份有限公司	36,400	22/01/2015	195,531	0.15
JIAOZUO WANFANG ALUMIMUM MANUFACTURING CO LTD	焦作萬方鋁業股份有限公司	12,600	22/01/2015	244,250	0.19
JILIN AODONG MEDICINE INDUSTRY GROUPS CO LTD	吉林敖東藥業集團股份有限公司	22,400	22/01/2015	681,850	0.54
JIZHONG ENERGY RESOURCES CO LTD	冀中能源股份有限公司	15,400	22/01/2015	392,042	0.31
LEAGUER STOCK CO LTD	力合股份有限公司	12,600	22/01/2015	103,978	0.08
LIAONING HUAJIN TONGDA CHEMICALS CO LTD	遼寧華錦通達化工股份有限公司	28,000	22/01/2015	248,500	0.20
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	瀘州老窖股份有限公司	30,800	22/01/2015	995,092	0.78
MILORD REAL ESTATE DEVELOPMENT GROUP CO LTD	名流置業集團股份有限公司	77,140	22/01/2015	276,250	0.22
NORTHEAST PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	東北制藥集團股份有限公司	7,000	22/01/2015	121,525	0.10
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	東北證券股份有限公司	8,400	22/01/2015	222,996	0.17
OCEANWIDE CONSTRUCTION GROUP CO LTD	泛海建設集團股份有限公司	21,000	22/01/2015	192,915	0.15
QINGHAI SALT LAKE POTASH	青海鹽湖鉀肥股份有限公司	18,200	22/01/2015	813,294	0.64
SEARAINBOW HOLDING CORP	海虹企業(控股)股份有限公司	26,600	22/01/2015	254,713	0.20
SGIS SONGSHAN CO LTD	廣東韶鋼松山股份有限公司	50,400	22/01/2015	204,032	0.16
SHANDONG CHENMING PAPER HLDGS LTD	山東晨鳴紙業集團股份有限公司	37,800	22/01/2015	279,563	0.22
SHANDONG DONG-E E-JIAO CO LTD	山東東阿阿膠股份有限公司	23,800	22/01/2015	944,955	0.74

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具(包括(但不限於)認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY UBS AG TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (38.89%) (CONTINUED)	由 UBS AG 發行的基礎證券， 以下列相關上市股票 追蹤 (38.89%) (續)				
SHANDONG HAIHUA CO LTD	山東海化股份有限公司	25,200	22/01/2015	149,100	0.12
SHANDONG JINLING MINING CO LTD	山東金嶺礦業股份有限公司	11,200	22/01/2015	165,667	0.13
SHANGHAI KEHUA BIO-ENGINEERING CO	上海科華生物工程股份有限公司	16,800	22/01/2015	282,506	0.22
SHANGHAI SIYUAN ELECTIC CO LTD	上海思源電氣股份有限公司	11,200	22/01/2015	326,102	0.26
SHANTUI CONSTRUCTION MACHINE CO LTD	山推工程機械股份有限公司	28,000	22/01/2015	350,952	0.28
SHANXI TAIGANG STAINLESS	山西太鋼不鏽鋼股份有限公司	98,000	22/01/2015	572,205	0.45
SHANXI XISHAN COAL & ELEC POWER CO LTD	山西西山煤電股份有限公司	69,160	22/01/2015	1,437,575	1.13
SHENYANG INGENIOUS DEVELOPMENT CO	瀋陽銀基發展股份有限公司	43,400	22/01/2015	182,452	0.14
SHENZHEN AGRICULTURAL PRODUCTS CO	深圳農產品股份有限公司	22,400	22/01/2015	406,320	0.32
SHENZHEN AIRPORT CO LTD	深圳機場股份有限公司	30,800	22/01/2015	184,631	0.14
SHENZHEN DEVELOPMENT BANK CO LTD	深圳發展銀行股份有限公司	124,600	22/01/2015	2,502,661	1.97
SHENZHEN ENERGY INVESTMENT CO LTD	深圳能源投資股份有限公司	28,000	22/01/2015	305,176	0.24
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	深圳開發科技股份有限公司	25,200	22/01/2015	306,048	0.24
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN HOLDINGS CO LTD	深圳華僑城股份有限公司	61,600	22/01/2015	776,891	0.61
SHENZHEN ZHENYE (GROUP) CO LTD	深圳振業(集團)股份有限公司	27,300	22/01/2015	161,525	0.13
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN NONFEMET CO LTD	深圳中金嶺南有色金屬股份有限公司	45,570	22/01/2015	674,057	0.53
SICHUAN NEW HOPE AGRI-BUSINESS CO LTD	四川新希望農業股份有限公司	16,800	22/01/2015	163,487	0.13
SUNING APPLIANCE CO LTD	蘇寧電器股份有限公司	180,600	22/01/2015	2,362,062	1.86
SUNING UNIVERSAL CO LTD	蘇寧環球股份有限公司	28,000	22/01/2015	276,838	0.22

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具(包括(但不限於)認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY UBS AG TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (38.89%) (CONTINUED)	由 UBS AG 發行的基礎證券， 以下列相關上市股票 追蹤 (38.89%) (續)				
TAIYUAN COAL GASIFICATION CO LTD	太原煤炭氣化有限公司	11,200	22/01/2015	174,386	0.14
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO. LTD.	唐山冀東水泥股份有限公司	29,400	22/01/2015	501,251	0.39
TCL CORPORATION	TCL 集團股份有限公司	95,200	22/01/2015	407,628	0.32
TIANJIN JINBIN DEVELOPMENT CO LTD	天津津濱發展股份有限公司	58,800	22/01/2015	270,081	0.21
TIANJIN TEDA CO LTD	天津泰達股份有限公司	46,200	22/01/2015	374,059	0.29
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	銅陵有色金屬集團控股有限公司	26,600	22/01/2015	441,088	0.35
WEICHAI POWER CO LTD	濰柴動力股份有限公司	12,600	22/01/2015	887,735	0.70
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY CO LTD	威孚高科技股份有限公司	16,800	22/01/2015	261,579	0.21
WULIANGYE YIBIN CO LTD	宜賓五糧液股份有限公司	79,800	22/01/2015	2,211,654	1.74
XI'AN AIRCRAFT INTERNATIONAL CORP	西安飛機國際航空製造股份有限公司	50,400	22/01/2015	565,011	0.44
XIANDAI INVESTMENT CO LTD	現代投資股份有限公司	12,600	22/01/2015	241,307	0.19
XINJIANG GOLDWIND SCI & TECH CO LTD	新疆金風科技股份有限公司	47,040	22/01/2015	838,623	0.66
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD	新疆中泰化學股份有限公司	14,000	22/01/2015	277,928	0.22
XINXING DUCTILE IRON PIPES	新興鑄管股份有限公司	45,500	22/01/2015	325,884	0.26
XJ ELECTRIC CO LTD	許繼電氣股份有限公司	12,600	22/01/2015	379,617	0.30
YANTAI CHANGYU PIONEER WINE CO LTD	煙台張裕葡萄酒股份有限公司	2,800	22/01/2015	256,348	0.20
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	雲南鋁業股份有限公司	25,200	22/01/2015	225,612	0.18
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	雲南白藥集團股份有限公司	8,400	22/01/2015	620,597	0.49
YUNNAN COPPER INDUSTRY CO LTD	雲南銅業 (集團) 有限公司	26,600	22/01/2015	544,630	0.43

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券—為追蹤A股表現的金融衍生工具 (包括 (但不限於) 認股權證、票據或參與證書)。

INVESTMENT PORTFOLIO (UNAUDITED)

投資組合 (未經審核)

as at 30th June 2010
於二零一零年六月三十日

		Holdings	Base Securities Maturity Date	Market value HKD	% of NAV 佔資產淨值 百分比 (%)
		持股量	基礎證券 到期日	市值 港元	
INVESTMENTS (94.46%) (CONTINUED)	投資 (94.46%) (續)				
CHINA (94.46%) (CONTINUED)	中國 (94.46%) (續)				
BASE SECURITIES ISSUED BY UBS AG TRACKED WITH BELOW UNDERLYING LISTED EQUITIES (38.89%) (CONTINUED)	由 UBS AG 發行的基礎證券， 以下列相關上市股票 追蹤 (38.89%) (續)				
ZHEJIANG NHU CO LTD	浙江新合成股份有限公司	7,280	22/01/2015	213,667	0.17
ZTE CORPORATION	中興通訊股份有限公司	60,900	22/01/2015	1,341,739	1.05
				<u>49,473,518</u>	<u>38.89</u>
Total Investments	投資總額			<u>120,149,972</u>	<u>94.46</u>
Other Net Assets	其他資產淨值			<u>7,051,556</u>	<u>5.54</u>
Total Net Assets	總資產淨值			<u><u>127,201,528</u></u>	<u><u>100.00</u></u>
Total Cost of Investment	投資成本總額			<u><u>155,780,564</u></u>	

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
基礎證券－為追蹤 A 股表現的金融衍生工具 (包括 (但不限於) 認股權證、票據或參與證書)。

STATEMENT OF MOVEMENTS IN PORTFOLIO HOLDINGS (UNAUDITED)
投資組合變動表(未經審核)

as at 30th June 2010
 於二零一零年六月三十日

		% of NAV 30th June 2010 佔資產淨值百分比(%) 二零一零年六月三十日
BASE SECURITIES ISSUED BY	由以下機構發行的基礎證券	
CITIGROUP GLOBAL	CITIGROUP GLOBAL	
MARKETS HOLDINGS INC.	MARKETS HOLDINGS INC.	5.56
ROYAL BANK OF SCOTLAND	ROYAL BANK OF SCOTLAND	
N.V., LONDON BRANCH	N.V., 倫敦分行	50.01
UBS AG	UBS AG	38.89
Total Investments	投資總額	94.46
Other Net Assets	其他資產淨值	5.54
Total Net Assets	總資產淨值	100.00

BASE SECURITIES-FINANCIAL DERIVATIVE (INCLUDING BUT NOT LIMITED TO WARRANT, A NOTE OR PARTICIPATION CERTIFICATE) WHICH TRACKS THE PERFORMANCE OF A SHARES
 基礎證券－為追蹤A股表現的金融衍生工具(包括(但不限於)認股權證、票據或參與證書)。

PERFORMANCE RECORD (UNAUDITED)
表現紀錄(未經審核)

		Net asset value per unit	
		每單位資產淨值	
		Lowest	Highest
		最低	最高
		HKD	HKD
		港元	港元
26th January 2010 to 30th June 2010	二零一零年一月二十六日至 二零一零年六月三十日	29.9298	39.7580
		30th June 2010	
		二零一零年六月三十日	
		HKD	
		港元	
Total net asset value	總資產淨值	127,201,528	
Net asset value per unit	每單位資產淨值	29.9298	

REPORT ON INVESTMENT OVERWEIGHT

投資比重增加報告

The CICC-SZSE 100 Index Tracker is permitted to overweight certain of the reference Index Shares of the Base Securities relative to the relevant Index Shares' respective weightings in the SZSE100 Index on the condition that the maximum extra weighting in any reference Index Share will not exceed four per cent under normal circumstances or such other percentage as determined by the Manager after consultation with the SFC.

The Manager confirmed that the CICC-SZSE 100 Index Tracker has complied with this limit during the period from 26th January 2010 to 30th June 2010.

中金深證100指數上市基金獲准將基礎證券的某些參考指數股份比重增加，比有關的指數股份各自在深證100指數所佔的比重為高，但條件是在正常情況下任何參考指數股份的最高額外比重將不超過百分之四，或將不超過基金經理在諮詢證監會之後所釐定的其他百分比。

基金經理確認中金深證100指數上市基金於二零一零年一月二十六日至二零一零年六月三十日期間符合此項限制。

HOLDINGS OF COLLATERAL

抵押品持有狀況

Pursuant to the SFC's Guidelines for regulating Index Tracking Exchange Traded Funds, we are presenting the holdings of collateral as following:-

As 30th June 2010, the CICC-SZSE 100 Index Tracker is only holding Hong Kong stocks as collateral. The collaterals are provided from The Royal Bank of Scotland N.V., London branch and UBS AG, acting through its London branch. As the date, the CICC-SZSE 100 was 73.05% covered by the collaterals.

根據證監會的跟蹤指數交易所買賣基金監管指引，吾等現呈列抵押品持有狀況如下：

於二零一零年六月三十日，中金深證100指數上市基金僅持有香港股票作為抵押品。抵押品由The Royal Bank of Scotland N.V. 倫敦分行及UBS AG (透過其倫敦分行行事) 提供。於該日，中金深證100指數上市基金的73.05%受抵押品保障。

MANAGEMENT AND ADMINISTRATION 管理及行政

Manager

China International Capital Corporation
Hong Kong Asset Management Limited
29th Floor, One International Finance Centre,
1 Harbour View Street, Central,
Hong Kong

Directors of the Manager

Dr. Zhu Yong
Mr. Han Wei Qiang
Mr. Yao Lei

Trustee and Registrar

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited
1 Queen's Road Central,
Hong Kong

Service Agent

HK Conversion Agency Services Limited
2nd Floor,
Vicwood Plaza,
199 Des Voeux Road Central,
Hong Kong

Listing Agent

China International Capital Corporation
Hong Kong Securities Limited
29th Floor, One International Finance Centre,
1 Harbour View Street, Central,
Hong Kong

Legal Adviser to the Manager

Baker & McKenzie
Solicitors
14th Floor, Hutchison House,
10 Harcourt, Central,
Hong Kong

Auditor

KPMG
8th Floor, Prince's Building,
10 Chater Road,
Central,
Hong Kong

Any opinion contained in this Interim Report (if any) reflects the Manager's view as at the date of this report and is subject to amendment(s) without notice. The information contained in this Interim Report does not constitute recommendation nor is it intended to provide any investment advice. Investors should refer to the Prospectus of the CICC-SZSE 100 Index Tracker for further details (including but not limited to risk factors, fees and charges and other important information) by visiting the website www.cicc.com.cn/etf.

Issued by China International Capital Corporation Hong Kong Asset Management Limited, the Manager of the CICC-SZSE 100 Index Tracker.

基金經理

中國國際金融香港資產管理有限公司
香港
中環港景街1號
國際金融中心一期29樓

基金經理的董事

朱勇博士
韓巍強先生
姚磊先生

受託人及名冊保管人

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司
香港
皇后大道中1號

服務代理人

香港證券兌換代理服務有限公司
香港
德輔道中199號
維德廣場2樓

上市代理人

中國國際金融香港證券有限公司
香港
中環港景街1號
國際金融中心一期29樓

基金經理的法律顧問

貝克•麥堅時律師事務所
香港
中環夏慤道10號
和記大廈14樓

核數師

畢馬威會計師事務所
香港中環
遮打道10號
太子大廈8樓

本中期報告內任何意見(如有)反映基金經理於本報告日期的觀點,可在未通知的情況下予以修改。本中期報告內資料並不構成推薦意見也無意提供任何投資建議。投資者應就進一步詳情登入網站www.cicc.com.cn/etf,參閱中金深證100指數上市基金認購章程(其中包括風險因素、費用及收費以及其他重要資料)。

由中金深證100指數的基金經理中國國際金融香港資產管理有限公司刊發。