



恒生投資
HANG SENG INVESTMENT

恒生指數追蹤基金 恒指 ESG 增強精選指數 ETF

中期財務報告

2024

目 錄

中期財務報告 2024	2
投資組合 (未經審核)	3
投資組合變動表 (未經審核)	8
簡明資產負債表 (未經審核)	12
簡明全面收入表 (未經審核)	13
簡明權益變動表 (未經審核)	14
派息披露 (未經審核)	15
指數及基金之表現 (未經審核)	16
恒指 ESG 增強精選指數 ETF – 每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核)	17
指數成份股披露 (未經審核)	18
基金就指數成份股額外投資比重限制之報告 (未經審核)	19
管理及行政	20

中期財務報告2024

恒生投資指數基金系列II

恒生指數追蹤基金

恒指ESG增強精選指數ETF (股份代號：3136)

本中期財務報告已採用上市基金的年報中所採用的相同會計政策及計算方法。

投資組合 (未經審核)

2024年6月30日

投資	恒生指數追蹤基金		
	單位數目	市值 (港元)	佔屬於單位 持有者之資產 淨值百分比
香港交易所上市股票			
綜合企業			
中國中信	23,609,741	167,629,161	0.47%
長江和記實業	8,685,107	324,823,002	0.91%
		492,452,163	1.38%
非必需性消費			
安踏體育用品	4,587,980	344,098,500	0.97%
比亞迪	3,377,529	783,586,728	2.20%
周大福珠寶集團	6,455,618	54,549,972	0.15%
銀河娛樂	7,083,954	257,855,926	0.72%
吉利汽車	19,599,146	172,276,493	0.48%
海底撈國際控股	5,404,246	75,875,614	0.21%
海爾智家	7,884,400	205,782,840	0.58%
理想汽車	4,473,000	314,451,900	0.88%
李寧	7,517,326	127,042,809	0.36%
港鐵公司	6,027,492	148,577,678	0.42%
金沙中國	9,154,655	149,037,783	0.42%
申洲國際集團	2,678,243	204,751,677	0.57%
創科實業	5,047,848	450,268,042	1.26%
攜程集團	554,500	207,715,700	0.58%
中升控股	2,691,301	30,734,658	0.09%
		3,526,606,320	9.89%
必需性消費			
百威亞太	6,420,031	59,064,285	0.16%
中國蒙牛	10,222,453	143,114,342	0.40%
華潤啤酒	5,242,005	137,602,631	0.39%
恒安國際	2,265,874	53,927,801	0.15%
農夫山泉	6,530,939	241,971,290	0.68%
康師傅控股	6,426,000	60,468,660	0.17%
萬洲國際	26,952,198	138,534,298	0.39%
		834,683,307	2.34%
能源業			
中國石油化工	78,967,980	399,577,979	1.12%
中國神華能源	10,941,274	393,338,800	1.10%
中國海洋石油	50,540,980	1,132,117,952	3.18%
中國石油天然氣	68,349,008	539,957,163	1.51%
		2,464,991,894	6.91%
金融業			
友邦保險控股	36,584,388	1,938,972,564	5.44%
中國銀行	270,879,601	1,042,886,464	2.92%
中銀香港	11,987,324	288,295,142	0.81%
中國建設銀行	350,461,925	2,022,165,307	5.67%
中國人壽保險	24,102,870	266,095,685	0.75%
招商銀行	12,650,591	448,463,451	1.26%
恒生銀行	2,477,363	248,727,245	0.70%
香港交易及結算所	3,901,744	976,216,349	2.74%
滙豐控股	43,303,743	2,957,645,647	8.29%
中國工商銀行	253,043,464	1,174,121,673	3.29%
中國平安保險	21,713,044	768,641,758	2.16%
		12,132,231,285	34.03%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生指數追蹤基金		
	單位數目	市值 (港元)	佔屬於單位 持有者之資產 淨值百分比
醫療保健業			
阿里健康信息技術	20,800,631	65,105,975	0.18%
石藥集團	28,973,812	180,217,111	0.51%
翰森製藥集團	3,860,478	63,003,001	0.18%
京東健康股份有限公司	3,607,350	76,656,187	0.22%
中國生物製藥	36,457,362	97,341,156	0.27%
國藥控股	4,336,400	89,980,300	0.25%
藥明康德	1,122,800	32,785,760	0.09%
藥明生物	12,385,781	142,931,913	0.40%
		748,021,403	2.10%
工業			
東方海外國際	426,728	54,066,438	0.15%
舜宇光學科技	2,303,942	111,165,202	0.31%
信義玻璃	6,880,433	58,896,506	0.17%
信義光能控股	15,881,680	62,415,002	0.17%
		286,543,148	0.80%
資訊科技業			
阿里巴巴集團	36,570,417	2,578,214,399	7.23%
百度	2,290,930	195,301,782	0.55%
比亞迪電子	2,548,500	99,391,500	0.28%
京東集團	5,150,100	532,005,330	1.49%
聯想集團	26,120,677	287,849,861	0.81%
美團	19,186,850	2,131,659,035	5.98%
網易	2,238,503	333,760,797	0.93%
中芯國際	13,549,230	231,962,818	0.65%
騰訊控股	7,859,835	2,927,002,554	8.21%
小米集團	56,572,121	932,308,554	2.61%
		10,249,456,630	28.74%
原材料業			
中國宏橋	9,186,911	108,589,288	0.30%
紫金礦業	17,656,000	290,970,880	0.82%
		399,560,168	1.12%
地產建築業			
中國海外發展	12,409,592	168,025,876	0.47%
華潤置地	10,395,235	275,993,489	0.78%
華潤萬象生活	2,213,000	57,206,050	0.16%
長江實業集團	6,334,377	185,280,527	0.52%
恒隆地產	5,859,680	39,025,469	0.11%
恒基兆業地產	4,721,065	98,906,312	0.28%
龍湖集團	7,632,728	81,822,844	0.23%
新世界發展	4,460,822	32,608,609	0.09%
新鴻基地產	4,224,183	285,343,561	0.80%
九龍倉置業地產投資	5,396,111	111,699,498	0.31%
		1,335,912,235	3.75%
電訊業			
中國移動	19,919,012	1,533,763,924	4.30%
中國聯通	19,777,366	141,803,714	0.40%
		1,675,567,638	4.70%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生指數追蹤基金		
	單位數目	市值 (港元)	佔屬於單位 持有人之資產 淨值百分比
公用事業			
華潤電力	6,218,000	148,921,100	0.42%
長江基建集團	2,035,415	89,761,802	0.25%
中電控股	6,547,370	413,139,047	1.16%
新奧能源	2,570,606	165,418,496	0.46%
香港中華煤氣	36,268,464	215,434,676	0.61%
電能實業	4,487,594	189,600,846	0.53%
		1,222,275,967	3.43%
所有股票		35,368,302,158	99.19%
房地產投資信託基金			
領展房地產投資信託基金	8,284,726	251,441,434	0.71%
總投資市值 (總投資成本 – 44,892,578,069港元)		35,619,743,592	99.90%
其他資產淨值		36,040,122	0.10%
屬於單位持有人之資產淨值		35,655,783,714	100.00%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒指ESG增強精選指數ETF		
	單位數目	市值 (港元)	佔屬於單位 持有人之資產 淨值百分比
香港交易所上市股票			
綜合企業			
長江和記實業	1,333	49,854	0.40%
非必需性消費			
安踏體育用品	5,501	412,575	3.27%
比亞迪	587	136,184	1.08%
周大福珠寶集團	9,408	79,498	0.63%
銀河娛樂	1,185	43,134	0.34%
吉利汽車	22,255	195,621	1.55%
海爾智家	1,156	30,172	0.24%
理想汽車	3,302	232,130	1.84%
李寧	11,768	198,879	1.58%
港鐵公司	4,218	103,974	0.83%
金沙中國	8,940	145,543	1.16%
申洲國際集團	3,236	247,392	1.96%
創科實業	1,014	90,449	0.72%
攜程集團	146	54,692	0.43%
中升控股	4,758	54,336	0.43%
		2,024,579	16.06%
必需性消費			
百威亞太	6,282	57,794	0.46%
中國蒙牛	1,159	16,226	0.13%
華潤啤酒	692	18,165	0.14%
恒安國際	300	7,140	0.06%
農夫山泉	1,407	52,129	0.41%
康師傅控股	550	5,176	0.04%
		156,630	1.24%
金融業			
友邦保險控股	19,237	1,019,561	8.09%
中國銀行	36,725	141,391	1.12%
中銀香港	9,958	239,490	1.90%
中國建設銀行	61,770	356,413	2.83%
中國人壽保險	6,960	76,838	0.61%
招商銀行	2,858	101,316	0.80%
恒生銀行	2,444	245,378	1.94%
香港交易及結算所	4,100	1,025,820	8.14%
滙豐控股	9,166	626,038	4.96%
中國工商銀行	32,831	152,336	1.21%
中國平安保險	24,994	884,788	7.02%
		4,869,369	38.62%
醫療保健業			
阿里健康信息技術	9,923	31,059	0.25%
石藥集團	3,301	20,532	0.16%
翰森製藥集團	1,125	18,360	0.15%
京東健康股份有限公司	2,324	49,385	0.39%
中國生物製藥	4,051	10,816	0.09%
國藥控股	4,562	94,662	0.75%
藥明康德	2,169	63,335	0.50%
藥明生物	23,099	266,562	2.11%
		554,711	4.40%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒指ESG增強精選指數ETF		
	單位數目	市值 (港元)	佔屬於單位 持有入之資產 淨值百分比
工業			
東方海外國際	292	36,997	0.29%
舜宇光學科技	564	27,213	0.22%
信義玻璃	1,034	8,851	0.07%
信義光能控股	3,380	13,283	0.10%
		86,344	0.68%
資訊科技業			
阿里巴巴集團	7,928	558,924	4.43%
比亞迪電子	970	37,830	0.30%
京東集團	1,001	103,403	0.82%
聯想集團	25,139	277,032	2.20%
美團	6,360	706,596	5.60%
網易	2,286	340,842	2.71%
中芯國際	1,339	22,924	0.18%
小米集團	39,358	648,620	5.14%
		2,696,171	21.38%
地產建築業			
中國海外發展	20,616	279,141	2.21%
華潤置地	3,969	105,377	0.83%
華潤萬象生活	4,347	112,370	0.89%
長江實業集團	7,659	224,026	1.78%
恒隆地產	10,539	70,190	0.56%
恒基兆業地產	5,368	112,459	0.89%
龍湖集團	7,896	84,645	0.67%
新鴻基地產	7,968	538,238	4.27%
九龍倉置業地產投資	5,780	119,646	0.95%
		1,646,092	13.05%
電訊業			
中國移動	3,580	275,660	2.18%
中國聯通	2,220	15,918	0.13%
		291,578	2.31%
公用事業			
長江基建集團	243	10,716	0.08%
新奧能源	840	54,054	0.43%
香港中華煤氣	15,184	90,193	0.72%
		154,963	1.23%
所有股票		12,530,291	99.37%
房地產投資信託基金			
領展房地產投資信託基金	18,842	571,855	4.54%
總投資市值 (總投資成本 – 19,096,683 港元)		13,102,146	103.91%
其他負債淨值		(492,957)	(3.91%)
屬於單位持有入之資產淨值		12,609,189	100.00%

投資組合變動表 (未經審核)

由2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生指數追蹤基金			
	單位數目 2024年1月1日	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
香港交易所上市股票				
綜合企業				
中國中信	23,627,741	1,499,000	1,517,000	23,609,741
長江和記實業	8,710,607	595,000	620,500	8,685,107
非必需性消費				
安踏體育用品	4,601,580	296,400	310,000	4,587,980
比亞迪	3,389,205	215,390	227,066	3,377,529
周大福珠寶集團	6,497,818	410,800	453,000	6,455,618
銀河娛樂	7,104,954	441,000	462,000	7,083,954
吉利汽車	19,617,146	1,300,000	1,318,000	19,599,146
海底撈國際控股	5,433,246	320,000	349,000	5,404,246
海爾智家	7,894,000	479,200	488,800	7,884,400
理想汽車	4,475,900	324,500	327,400	4,473,000
李寧	7,707,826	338,000	528,500	7,517,326
港鐵公司	6,056,992	390,000	419,500	6,027,492
金沙中國	9,203,055	522,400	570,800	9,154,655
申洲國際集團	2,686,143	169,200	177,100	2,678,243
創科實業	5,067,348	318,000	337,500	5,047,848
攜程集團	444,150	142,200	31,850	554,500
中升控股	2,719,301	124,000	152,000	2,691,301
必需性消費				
百威亞太	6,453,931	439,500	473,400	6,420,031
中國蒙牛	10,240,453	677,000	695,000	10,222,453
華潤啤酒	5,271,005	300,500	329,500	5,242,005
恒安國際	2,265,374	112,000	111,500	2,265,874
農夫山泉	6,542,939	419,800	431,800	6,530,939
康師傅控股	6,408,000	574,000	556,000	6,426,000
萬洲國際	27,094,698	1,595,500	1,738,000	26,952,198
能源業				
中國石油化工	80,403,980	4,878,000	6,314,000	78,967,980
中國神華能源	10,973,274	739,000	771,000	10,941,274
中國海洋石油	50,688,980	3,383,000	3,531,000	50,540,980
中國石油天然氣	68,549,008	4,682,000	4,882,000	68,349,008
金融業				
友邦保險控股	37,419,388	2,125,200	2,960,200	36,584,388
中國銀行	271,678,601	17,929,000	18,728,000	270,879,601
中銀香港	12,022,824	760,000	795,500	11,987,324
中國建設銀行	351,487,925	23,259,000	24,285,000	350,461,925
中國人壽保險	24,175,870	1,311,000	1,384,000	24,102,870
招商銀行	12,678,091	892,500	920,000	12,650,591
恒生銀行	2,484,563	165,000	172,200	2,477,363
香港交易及結算所	3,913,144	266,500	277,900	3,901,744
滙豐控股	48,162,943	1,815,600	6,674,800	43,303,743
中國工商銀行	239,685,464	29,931,000	16,573,000	253,043,464
中國平安保險	21,777,044	1,440,000	1,504,000	21,713,044
醫療保健業				
阿里健康信息技術	17,588,631	4,460,000	1,248,000	20,800,631
石藥集團	29,005,812	2,110,000	2,142,000	28,973,812
翰森製藥集團	3,856,478	180,000	176,000	3,860,478
京東健康股份有限公司	3,616,350	235,200	244,200	3,607,350
中國生物製藥	36,650,362	2,283,000	2,476,000	36,457,362
國藥控股	4,359,600	266,000	289,200	4,336,400
藥明康德	1,177,100	5,400	59,700	1,122,800
藥明生物	12,429,281	735,500	779,000	12,385,781

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生指數追蹤基金			
	單位數目 2024年1月1日	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
工業				
東方海外國際	429,228	21,500	24,000	426,728
舜宇光學科技	2,316,342	155,200	167,600	2,303,942
信義玻璃	6,765,433	537,000	422,000	6,880,433
信義光能控股	15,909,680	814,000	842,000	15,881,680
資訊科技業				
阿里巴巴集團	38,640,217	2,261,800	4,331,600	36,570,417
百度	2,297,680	129,200	135,950	2,290,930
比亞迪電子	–	2,564,500	16,000	2,548,500
京東集團	5,681,700	235,500	767,100	5,150,100
聯想集團	25,612,677	1,986,000	1,478,000	26,120,677
美團	19,268,150	1,262,000	1,343,300	19,186,850
網易	2,245,103	154,600	161,200	2,238,503
中芯國際	13,581,730	847,000	879,500	13,549,230
騰訊控股	8,989,135	1,119,300	2,248,600	7,859,835
小米集團	56,916,321	3,518,600	3,862,800	56,572,121
原材料業				
中國宏橋	9,235,911	385,000	434,000	9,186,911
紫金礦業	17,708,000	1,234,000	1,286,000	17,656,000
地產建築業				
中國海外發展	12,445,592	774,000	810,000	12,409,592
華潤置地	10,426,735	702,000	733,500	10,395,235
華潤萬象生活	2,224,800	122,400	134,200	2,213,000
長江實業集團	6,345,377	381,000	392,000	6,334,377
碧桂園服務控股	7,059,947	246,000	7,305,947	–
恒隆地產	5,847,680	245,000	233,000	5,859,680
恒基兆業地產	4,719,065	331,000	329,000	4,721,065
龍湖集團	7,495,728	641,000	504,000	7,632,728
新世界發展	4,497,822	186,000	223,000	4,460,822
新鴻基地產	4,707,683	173,000	656,500	4,224,183
九龍倉置業地產投資	5,426,111	330,000	360,000	5,396,111
電訊業				
中國移動	19,966,012	1,339,000	1,386,000	19,919,012
中國聯通	19,883,366	1,142,000	1,248,000	19,777,366
公用事業				
華潤電力	6,252,000	376,000	410,000	6,218,000
長江基建集團	2,046,915	132,500	144,000	2,035,415
中電控股	6,566,870	424,000	443,500	6,547,370
新奧能源	2,572,706	177,400	179,500	2,570,606
香港中華煤氣	36,374,464	2,268,000	2,374,000	36,268,464
電能實業	4,500,594	256,500	269,500	4,487,594
房地產投資信託基金				
領展房地產投資信託基金	8,323,426	514,700	553,400	8,284,726

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒指ESG增強精選指數ETF			
	單位數目 2024年1月1日	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
香港交易所上市股票				
綜合企業				
長江和記實業	6,500	187	5,354	1,333
非必需性消費				
安踏體育用品	26,800	–	21,299	5,501
比亞迪	2,500	240	2,153	587
周大福珠寶集團	40,400	972	31,964	9,408
銀河娛樂	6,000	–	4,815	1,185
吉利汽車	97,000	3,449	78,194	22,255
海底撈國際控股	3,000	–	3,000	–
海爾智家	6,200	–	5,044	1,156
理想汽車	10,000	1,430	8,128	3,302
李寧	57,500	500	46,232	11,768
港鐵公司	21,000	361	17,143	4,218
金沙中國	43,600	319	34,979	8,940
申洲國際集團	16,200	100	13,064	3,236
創科實業	5,000	–	3,986	1,014
攜程集團	600	23	477	146
中升控股	23,000	–	18,242	4,758
必需性消費				
百威亞太	29,900	100	23,718	6,282
中國蒙牛	6,000	–	4,841	1,159
華潤啤酒	4,000	–	3,308	692
恒安國際	1,500	–	1,200	300
農夫山泉	7,000	–	5,593	1,407
康師傅控股	2,000	2,000	3,450	550
金融業				
友邦保險控股	79,600	2,289	62,652	19,237
中國銀行	163,000	12,000	138,275	36,725
中銀香港	17,000	6,500	13,542	9,958
中國建設銀行	224,000	13,000	175,230	61,770
中國人壽保險	24,000	2,216	19,256	6,960
招商銀行	14,000	14	11,156	2,858
恒生銀行	12,300	–	9,856	2,444
香港交易及結算所	19,500	164	15,564	4,100
滙豐控股	49,200	450	40,484	9,166
中國工商銀行	134,000	5,819	106,988	32,831
中國平安保險	109,000	1,856	85,862	24,994
醫療保健業				
阿里健康信息技術	36,000	3,624	29,701	9,923
石藥集團	16,000	–	12,699	3,301
翰森製藥集團	6,000	–	4,875	1,125
京東健康股份有限公司	11,400	1,000	10,076	2,324
中國生物製藥	19,000	–	14,949	4,051
國藥控股	22,400	–	17,838	4,562
藥明康德	8,400	600	6,831	2,169
藥明生物	90,500	3,565	70,966	23,099

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒指ESG增強精選指數ETF			
	單位數目 2024年1月1日	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
工業				
東方海外國際	1,500	–	1,208	292
舜宇光學科技	3,100	–	2,536	564
信義玻璃	5,000	259	4,225	1,034
信義光能控股	24,000	125	20,745	3,380
資訊科技業				
阿里巴巴集團	32,300	1,200	25,572	7,928
比亞迪電子	–	970	–	970
京東集團	5,550	50	4,599	1,001
聯想集團	130,000	397	105,258	25,139
美團	28,100	844	22,584	6,360
網易	11,300	44	9,058	2,286
中芯國際	6,500	286	5,447	1,339
小米集團	217,800	400	178,842	39,358
地產建築業				
中國海外發展	78,000	3,852	61,236	20,616
華潤置地	22,000	–	18,031	3,969
華潤萬象生活	20,600	200	16,453	4,347
長江實業集團	34,000	338	26,679	7,659
碧桂園服務控股	64,000	5,903	69,903	–
恒隆地產	40,000	2,800	32,261	10,539
恒基兆業地產	26,000	163	20,795	5,368
龍湖集團	52,500	–	44,604	7,896
新鴻基地產	41,000	511	33,543	7,968
九龍倉置業地產投資	26,000	595	20,815	5,780
電訊業				
中國移動	17,000	–	13,420	3,580
中國聯通	10,000	374	8,154	2,220
公用事業				
長江基建集團	–	258	15	243
新奧能源	2,100	400	1,660	840
香港中華煤氣	97,000	–	81,816	15,184
房地產投資信託基金				
領展房地產投資信託基金	90,320	941	72,419	18,842

簡明資產負債表 (未經審核)

2024年6月30日

	恒生指數追蹤基金		恒指ESG增強精選指數ETF	
	30-06-2024 (未經審核) (港元)	31-12-2023 (已經審核) (港元)	30-06-2024 (未經審核) (港元)	31-12-2023 (已經審核) (港元)
資產				
按公平價值列入收入或虧損的金融資產	35,619,743,592	35,231,717,338	13,102,146	66,894,013
應收股息款項	265,489,523	44,495,435	116,525	48,808
應收認購單位款項	196,221,787	109,074,716	–	–
應收投資款項	259,574,710	96,228,051	166	–
其他應收款項	51,374	2,837	38	60,807
現金及現金等價物	90,162,633	217,664,775	115,886	188,827
資產總值	36,431,243,619	35,699,183,152	13,334,761	67,192,455
負債				
應付投資款項	82,495,098	108,932,896	–	650,533
應付贖回單位款項	135,687,456	305,450,798	–	–
預提費用及其他應付款項	4,409,127	4,889,754	575,572	223,050
應付單位持有人收益分派款項	552,868,224	–	150,000	–
負債總值	775,459,905	419,273,448	725,572	873,583
屬於單位持有人之資產淨值	35,655,783,714	35,279,909,704	12,609,189	66,318,872
代表：				
權益總值	35,655,783,714	35,279,909,704	12,609,189	66,318,872
已發行單位數目	1,978,375,733	2,038,686,120	1,500,000	6,900,000
每單位資產淨值	18.0228	17.3052	8.4061	9.6114

簡明全面收入表 (未經審核)

截至2024年6月30日止半年

	恒生指數追蹤基金		恒指ESG增強精選指數ETF	
	截至2024年 6月30日止半年 (未經審核) (港元)	截至2023年 6月30日止半年 (未經審核) (港元)	截至2024年 6月30日止半年 (未經審核) (港元)	截至2023年 6月30日止半年 (未經審核) (港元)
收入				
股息收入	786,354,477	660,188,008	303,877	1,370,473
利息收入	475,319	304,566	154	29
基金經理費用付償	-	-	446,149	357,860
其他收入	-	1,600	-	-
	786,829,796	660,494,174	750,180	1,728,362
費用				
核數師酬金	(299,065)	(314,160)	(36,475)	(54,843)
法律及專業服務費用	(275,642)	-	(106)	-
管理費	(6,078,991)	(6,594,371)	(7,747)	(31,990)
登記處費	(7,757)	(7,736)	(7,757)	(7,736)
證券託管及銀行費用	(687,355)	(780,294)	(661)	(3,924)
雜項費用	(2,769,076)	(3,261,786)	(181,666)	(177,757)
投資交易費用	(7,570,964)	(11,729,255)	(3,941)	(24,148)
付予行政人之交易費	(104,400)	(110,900)	(3,935)	(3,967)
受託人費	(1,038,501)	(1,202,865)	(17,262)	(17,405)
基金行政費	(4,154,002)	(4,783,555)	(79,568)	(78,000)
估值費	(48,400)	(48,000)	-	-
	(23,034,153)	(28,832,922)	(339,118)	(399,770)
計算投資收益／(虧損) 前的收入	763,795,643	631,661,252	411,062	1,328,592
投資收益／(虧損)				
投資淨收益／(虧損)	1,351,649,546	(1,707,238,242)	(9,007,781)	(8,223,313)
匯兌淨(虧損)／收益	(2,576)	(75,167)	59	(406)
證券費用	(174,162)	(361,521)	(304)	(864)
	1,351,472,808	(1,707,674,930)	(9,008,026)	(8,224,583)
計算融資成本前的收入／(損失)	2,115,268,451	(1,076,013,678)	(8,596,964)	(6,895,991)
融資成本				
利息支出	(16,315)	(33,703)	(14,187)	(20,063)
稅前收入／(損失)	2,115,252,136	(1,076,047,381)	(8,611,151)	(6,916,054)
稅項	(19,313,459)	(20,379,447)	(5,952)	(27,985)
屬於單位持有人的收入／(損失) 及期間 總全面收入	2,095,938,677	(1,096,426,828)	(8,617,103)	(6,944,039)

簡明權益變動表 (未經審核)

截至2024年6月30日止半年

	恒生指數追蹤基金		恒指ESG增強精選指數ETF	
	截至2024年 6月30日止半年 (未經審核) (港元)	截至2023年 6月30日止半年 (未經審核) (港元)	截至2024年 6月30日止半年 (未經審核) (港元)	截至2023年 6月30日止半年 (未經審核) (港元)
期初餘額	35,279,909,704	39,008,899,251	66,318,872	77,189,979
屬於單位持有人的收入／(損失) 及期間 總全面收入	2,095,938,677	(1,096,426,828)	(8,617,103)	(6,944,039)
與所有者 (即單位持有人) 的交易 並直接於權益上入賬				
發行單位所得及應收款項	6,956,583,626	7,808,463,554	–	7,326,360
贖回單位所付及應付款項	(8,003,359,216)	(7,201,386,468)	(44,942,580)	–
予單位持有人的收益分派	(673,289,077)	(629,859,193)	(150,000)	(1,005,000)
與所有者 (即單位持有人) 的交易總額	(1,720,064,667)	(22,782,107)	(45,092,580)	6,321,360
期末餘額	35,655,783,714	37,889,690,316	12,609,189	76,567,300

	截至2024年 6月30日止半年 (單位數目)	截至2023年 6月30日止半年 (單位數目)	截至2024年 6月30日止半年 (單位數目)	截至2023年 6月30日止半年 (單位數目)
基金之已發行單位變動如下：				
期初單位結餘	2,038,686,120	1,941,706,399	6,900,000	6,300,000
期間內發行單位數目	396,717,376	379,629,856	–	600,000
期間內贖回單位數目	(457,027,763)	(348,446,408)	(5,400,000)	–
期末單位結餘	1,978,375,733	1,972,889,847	1,500,000	6,900,000

派息披露 (未經審核)

由2024年1月1日至2024年6月30日期間與2023年同期之比較

恒生指數追蹤基金

	除息日期	分派日期	每單位收益 分派 (港元)	收益分派 總額 (港元)
2024年第二季度收益分派	27-06-2024	30-07-2024	0.28	552,868,224
2024年第一季度收益分派	27-03-2024	15-04-2024	0.06	120,420,853
2023年第二季度收益分派	29-06-2023	28-07-2023	0.25	493,334,064
2023年第一季度收益分派	30-03-2023	14-04-2023	0.07	136,525,129

恒指ESG增強精選指數ETF

	除息日期	分派日期	每單位收益 分派 (港元)	收益分派 總額 (港元)
2024年第二季度收益分派	27-06-2024	30-07-2024	0.10	150,000
2023年第二季度收益分派	29-06-2023	28-07-2023	0.10	690,000
2023年第一季度收益分派	30-03-2023	14-04-2023	0.05	315,000

指數及基金之表現 (未經審核)

由2024年1月1日至2024年6月30日期間與2023年同期之比較

以港元計算之表現

基金／指數	由2024年1月1日至 2024年6月30日期間	由2023年1月1日至 2023年6月30日期間
恒生指數追蹤基金*	6.14%	-2.82%
恒生指數#	6.16%	-2.79%

以港元計算之表現

基金／指數	由2024年1月1日至 2024年6月30日期間	由2023年1月1日至 2023年6月30日期間
恒指ESG增強精選指數ETF*	-8.30%	-8.26%
恒指ESG增強精選指數#	-8.09%	-8.21%

資料來源：單位價格或資產淨值由滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司提供。基金之表現資料由基金經理提供。指數資料由恒生指數有限公司提供。

* 對於恒生指數追蹤基金，表現以報價貨幣之單位價格對單位價格計算，股息(如有)再投資之總回報計算。對於恒指ESG增強精選指數ETF，表現以報價貨幣之資產淨值對資產淨值計算，股息(如有)再投資之總回報計算。所呈列的表現資料乃是基於沒有向單位持有人作出派息的假設而計算，並僅供參考之用。

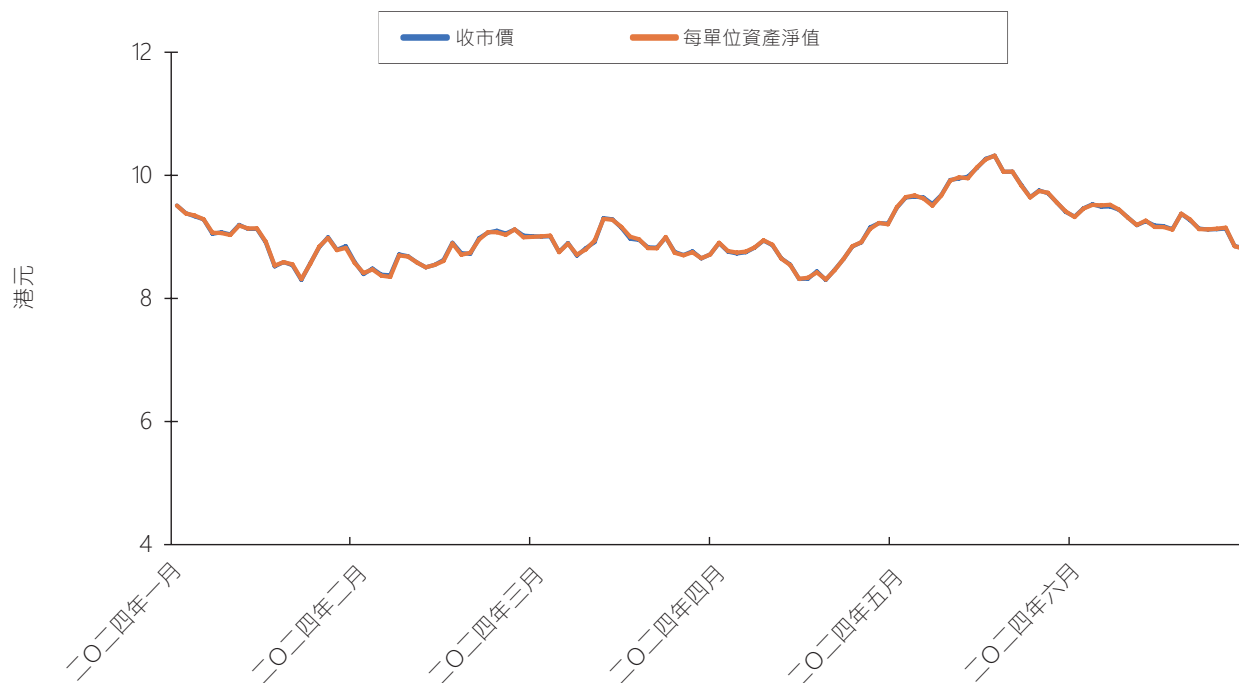
表現以股息再投資之總回報計算，總回報為扣除預扣稅後之淨值。

投資者須注意，所有投資均涉及風險(包括可能會損失投資本金)，基金單位價格可升亦可跌，過往表現並不可作為日後表現的指引。投資者在作出任何投資決定前，應詳細閱讀有關基金之銷售文件(包括當中所載之風險因素之全文)。

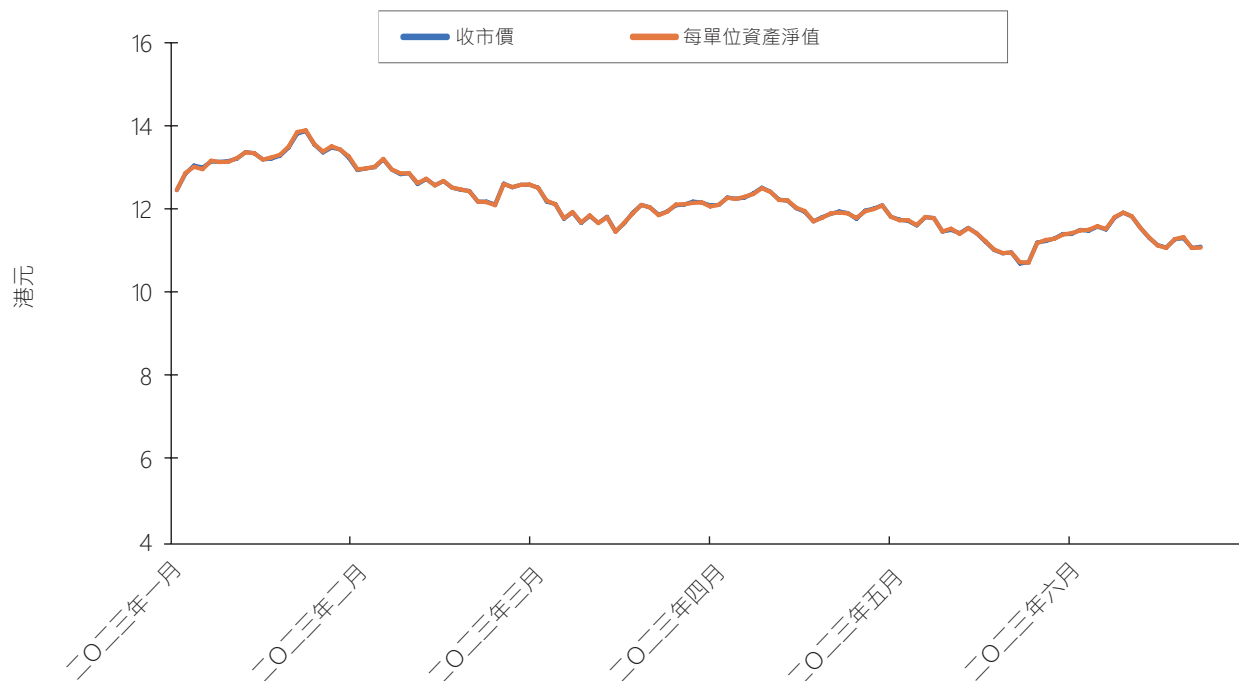
恒指ESG增強精選指數ETF – 每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核)

由2024年1月1日至2024年6月30日期間與2023年同期之比較

由2024年1月1日至2024年6月30日之每日收市價及每單位資產淨值之比較



由2023年1月1日至2023年6月30日之每日收市價及每單位資產淨值之比較



指數成份股披露 (未經審核)

2024年6月30日

2024年6月30日

基金	指數	成份股	佔指數比重 (百分比)
恒生指數追蹤基金	於2024年6月28日，恒生指數沒有佔指數比重多於百分之十的成份股。		
恒指ESG增強精選指數ETF	於2024年6月28日，恒指ESG增強精選指數沒有佔指數比重多於百分之十的成份股。		

2023年6月30日

基金	指數	成份股	佔指數比重 (百分比)
恒生指數追蹤基金	於2023年6月30日，恒生指數沒有佔指數比重多於百分之十的成份股。		
恒指ESG增強精選指數ETF	於2023年6月30日，恒指ESG增強精選指數沒有佔指數比重多於百分之十的成份股。		

基金就指數成份股額外投資比重限制之報告 (未經審核)

由2024年1月1日至2024年6月30日

根據基金之香港銷售文件中所述，若基金經理(恒生投資管理有限公司)為基金作出投資時實施具代表性之樣本複製策略，基金經理將根據基金之有關投資限制應用該策略，以令基金經理可根據以下限制相對於指數內的恒生指數及恒指ESG增強精選指數(「指數」)成份股各相應比重調高其比重。

股份於該指數內的比重	可分配之最高額外比重
10%以下	4% ¹
10%至30%	4%
30%至50%	3%
50%以上	2%

¹ 當持有的指數成份股於該指數所佔比重低於10%，且倘於分配最高額外比重4%後該成份股的分配總比重仍低於10%時，分配至該成份股的總比重可能最高調至10%。

於2024年1月1日至2024年6月30日期間內，基金經理為恒生指數追蹤基金及恒指ESG增強精選指數ETF作出投資時採用全面複製策略，因此以上限制並不適用。

管理及行政

基金經理 (就恒生追蹤基金及恒指ESG增強精選指數ETF)

上市代理人 (僅就恒指ESG增強精選指數ETF而言)

恒生投資管理有限公司

香港

中環

德輔道中83號

基金經理之董事

張家慧

趙蕙雯

李佩珊

李樺倫

蘇雪冰

薛永輝

SKEVINGTON Dominic Adam (於2024年5月27日獲委任)

WHITE Stuart Kingsley (於2024年5月27日辭任)

受託人

花旗信託有限公司

香港

中環

花園道3號

冠君大廈50樓

登記處

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司

香港

中環

皇后大道中1號

核數師

畢馬威會計師事務所

執業會計師

(於《財務匯報局條例》下的註冊公眾利益實體核數師)

香港

中環

遮打道10號

太子大廈8樓

服務代理人


香港證券兌換代理服務有限公司

香港

中環

康樂廣場8號

交易廣場二期8樓



由恒生投資管理有限公司
(恒生銀行全資附屬機構) 刊發