



恒生投資
HANG SENG INVESTMENT

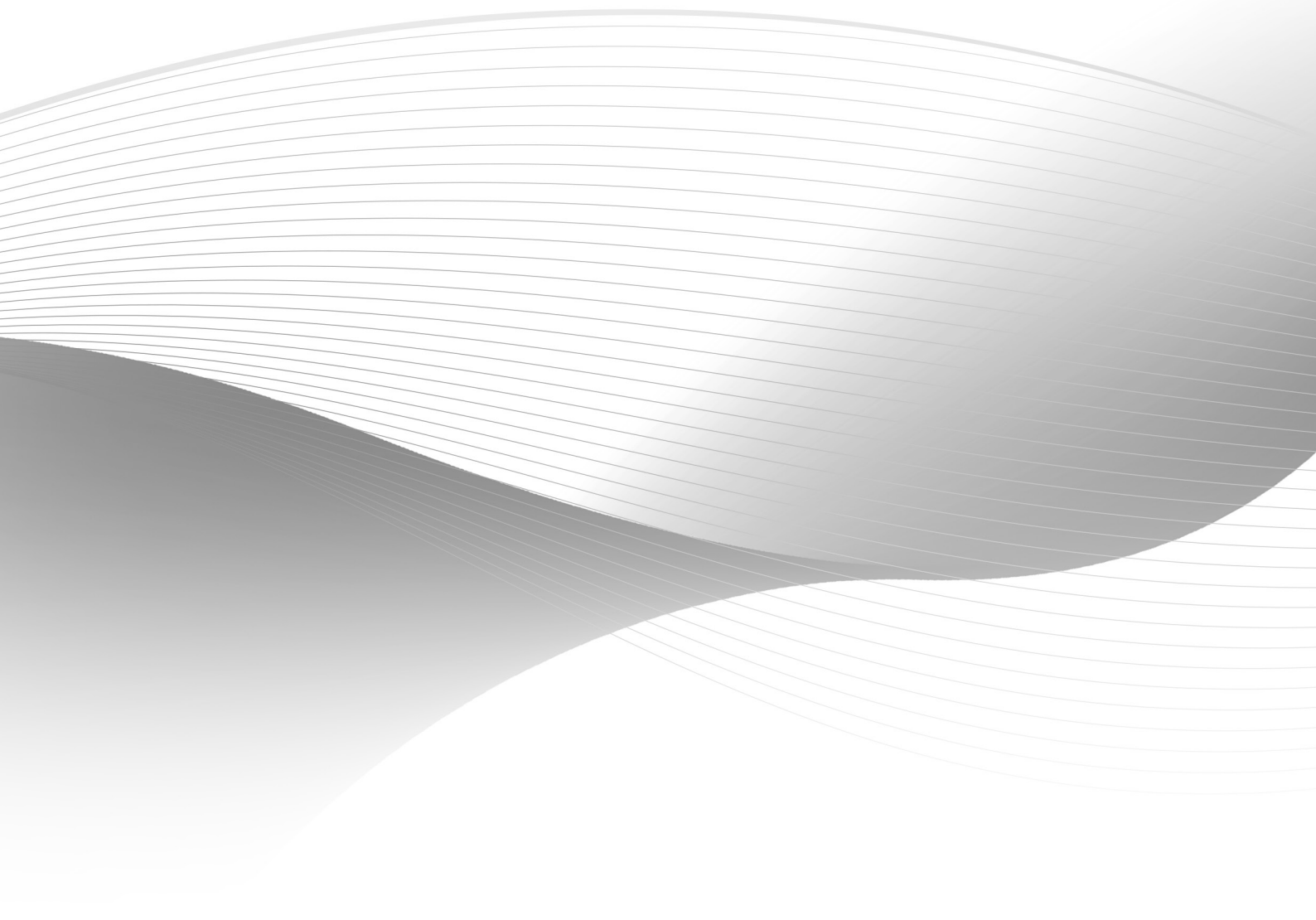
恒生 A 股行業龍頭指數 ETF
恒生嘉實滬深 300 指數 ETF
恒生 A 股通低碳指數 ETF
恒生標普 500 指數 ETF

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)	32
簡明資產負債表 (未經審核)	57
簡明全面收入表 (未經審核)	58
簡明權益變動表/屬於單位持有人之資產淨值變動表 (未經審核)	59
派息披露 (未經審核)	62
指數及上市基金之表現 (未經審核)	63
上市基金每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核)	64
指數成份股披露 (未經審核)	68
上市基金就投資限制之報告 (未經審核)	69
管理及行政	70



中期財務報告2024

恒生投資指數基金系列IV

恒生A股行業龍頭指數ETF (股份代號：3128/83128)

恒生嘉實滬深300指數ETF (股份代號：3130/83130)

恒生A股通低碳指數ETF (股份代號：3038/83038)

恒生標準普爾500指數ETF (股份代號：3195/9195)

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A股行業龍頭指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
上海證券交易所上市股票			
非必需性消費			
海爾智家	71,074	2,017,080	1.54%
上海汽車	54,022	748,745	0.57%
		2,765,825	2.11%
必需性消費			
海天味業	36,486	1,257,673	0.96%
內蒙古伊利實業	113,570	2,934,649	2.24%
貴州茅臺酒	8,090	11,871,185	9.07%
		16,063,507	12.27%
能源業			
中國石油化工	273,684	1,729,683	1.32%
中國神華能源	61,965	2,749,387	2.10%
中國石油天然氣	212,450	2,192,484	1.67%
陝西煤業	63,594	1,638,817	1.25%
兗礦能源	21,626	491,559	0.38%
		8,801,930	6.72%
金融業			
中國農業銀行	599,709	2,614,731	2.00%
中國銀行	394,914	1,824,503	1.40%
中國建設銀行	126,184	933,761	0.71%
中國工商銀行	759,710	4,330,347	3.31%
中國平安保險	192,124	7,946,249	6.07%
		17,649,591	13.49%
醫療保健業			
江蘇恒瑞醫藥	77,899	2,995,996	2.29%
上海復星醫藥	23,710	524,939	0.40%
藥明康德	38,200	1,497,058	1.14%
		5,017,993	3.83%
工業			
中遠海控	107,578	1,666,383	1.27%
隆基綠能科技	120,748	1,692,887	1.29%
		3,359,270	2.56%
資訊科技業			
工業富聯	74,624	2,044,698	1.56%
中芯國際	35,204	1,622,904	1.24%
上海韋爾半導體	14,855	1,476,142	1.13%
		5,143,744	3.93%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股行業龍頭指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
原材料業			
寶山鋼鐵	145,520	967,708	0.74%
恒力石化	39,796	555,154	0.43%
萬華化學	32,408	2,620,511	2.00%
紫金礦業	290,096	5,096,987	3.89%
		9,240,360	7.06%
地產建築業			
安徽海螺水泥	41,280	973,795	0.75%
中國交通建設	44,554	398,313	0.30%
中國中鐵	173,724	1,132,680	0.87%
中國建築	350,914	1,863,353	1.42%
		4,368,141	3.34%
電訊業			
中國移動	14,382	1,546,065	1.18%
中國衛通集團	12,058	169,897	0.13%
中國電信	290,884	1,788,937	1.37%
中國聯通	268,896	1,263,811	0.96%
		4,768,710	3.64%
公用事業			
中國核能電力	159,218	1,697,264	1.30%
三峽能源	241,998	1,055,111	0.81%
中國長江電力	206,920	5,984,126	4.57%
華能國電	82,109	789,889	0.60%
		9,526,390	7.28%
深圳證券交易所上市股票			
非必需性消費			
比亞迪	16,996	4,253,249	3.25%
珠海格力電器	84,618	3,318,718	2.54%
美的集團	91,670	5,912,715	4.52%
		13,484,682	10.31%
必需性消費			
牧原食品股份有限公司	46,134	2,011,442	1.54%
宜賓五糧液	36,422	4,663,473	3.56%
		6,674,915	5.10%
醫療保健業			
邁瑞醫療	11,396	3,315,210	2.53%
雲南白藥	13,426	686,740	0.53%
		4,001,950	3.06%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股行業龍頭指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
工業			
寧德時代	49,596	8,928,768	6.82%
立訊精密工業	87,620	3,444,342	2.63%
順豐控股	41,276	1,473,141	1.13%
		13,846,251	10.58%
資訊科技業			
杭州海康威視數字技術	69,941	2,161,876	1.65%
中興通訊	60,522	1,692,800	1.29%
		3,854,676	2.94%
原材料業			
榮盛石化	66,094	638,468	0.49%
地產建築業			
萬科企業	118,749	822,931	0.63%
公用事業			
中國廣核電力	111,268	515,171	0.39%
總投資市值		130,544,505	99.73%
(總投資成本 – 124,719,179人民幣)			
其他資產淨值		358,716	0.27%
屬於單位持有人之資產淨值		130,903,221	100.00%

投資	恒生嘉實滬深300指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
深圳證券交易所上市股票			
交易所買賣基金			
嘉實滬深300 ETF	13,440,800	48,722,900	99.74%
總投資市值		48,722,900	99.74%
(總投資成本 – 64,921,110人民幣)			
其他資產淨值		125,004	0.26%
屬於單位持有人之資產淨值		48,847,904	100%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股通低氫指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
上海證券交易所上市股票			
非必需性消費			
中國國航	24,402	180,087	0.16%
星宇股份	979	109,687	0.10%
中國東方航空	46,064	184,716	0.17%
中國南方航空	24,290	143,068	0.13%
重慶小康	4,892	445,759	0.41%
科沃斯	1,618	76,337	0.07%
福耀玻璃	9,353	448,009	0.41%
公牛集團	1,305	100,641	0.09%
長城汽車	7,815	197,720	0.18%
廣汽集團	13,942	107,911	0.10%
海爾智家	25,810	732,488	0.67%
海南航空	154,140	157,223	0.14%
華域汽車	9,384	153,710	0.14%
拓普集團	2,517	134,936	0.12%
歐派家居	1,188	63,629	0.06%
上汽集團	18,575	257,450	0.23%
上海機場	7,000	225,750	0.20%
錦江酒店	2,802	64,390	0.06%
晨光股份	3,111	97,312	0.09%
春秋航空	2,912	164,033	0.15%
		4,044,856	3.68%
必需性消費			
安徽迎駕	1,536	88,320	0.08%
重慶啤酒	1,414	85,830	0.08%
東鵬飲料	908	195,901	0.18%
海天味業	12,340	425,360	0.39%
內蒙古伊利實業	38,410	992,514	0.90%
今世緣	4,682	216,308	0.20%
貴州茅臺酒	3,364	4,936,300	4.50%
山西汾酒	2,962	624,626	0.57%
青島啤酒	1,762	128,221	0.11%
		7,693,380	7.01%
能源業			
中海油田服務	3,703	63,692	0.06%
中國海洋石油	12,075	398,475	0.36%
		462,167	0.42%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股通低氫指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	估屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
金融業			
中國農業銀行	239,975	1,046,291	0.95%
北京銀行	134,889	787,752	0.72%
成都銀行	17,613	267,542	0.24%
中國銀行	161,483	746,051	0.68%
交通銀行	184,344	1,377,050	1.25%
杭州銀行	30,634	399,774	0.36%
江蘇銀行	118,580	881,049	0.80%
南京銀行	40,352	419,257	0.38%
上海銀行	80,701	585,889	0.53%
中信銀行	27,036	181,141	0.17%
中國建設銀行	52,545	388,833	0.35%
中國光大銀行	219,872	696,994	0.64%
中國銀河	18,229	197,967	0.18%
中金公司	7,137	211,327	0.19%
中國人壽保險	13,848	429,980	0.39%
招商銀行	86,374	2,953,127	2.69%
招商證券	26,785	372,579	0.34%
中國民生銀行	218,635	828,627	0.76%
中國太保	27,883	776,820	0.71%
浙商銀行	134,059	370,003	0.34%
中信証券	71,547	1,304,302	1.19%
中信建投證券	14,675	282,347	0.26%
光大證券	16,148	236,084	0.21%
方正證券	35,050	270,937	0.25%
國泰君安	33,870	458,939	0.42%
海通證券	66,979	573,340	0.52%
華泰證券	45,049	558,157	0.51%
華夏銀行	46,873	299,987	0.27%
中國工商銀行	303,539	1,730,172	1.58%
興業銀行	120,160	2,117,219	1.93%
興業證券	53,292	269,658	0.25%
新華保險	7,776	233,513	0.21%
東方證券	40,702	309,335	0.28%
中國人保	37,356	192,383	0.18%
中國平安保險	71,241	2,946,528	2.68%
中國郵政儲蓄銀行	111,747	566,557	0.52%
浦發銀行	134,524	1,107,133	1.01%
滬農商行	39,313	264,183	0.24%
浙商證券	16,609	178,049	0.16%
中泰證券	24,211	137,276	0.13%
		27,954,152	25.47%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股通低碳指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
醫療保健業			
同仁堂	4,344	165,984	0.15%
萬泰生物	2,646	174,319	0.16%
華熙生物	1,360	76,935	0.07%
白雲山	5,035	147,677	0.13%
江蘇恒瑞醫藥	26,498	1,019,113	0.93%
上海復星醫藥	8,986	198,950	0.18%
上海醫藥	7,200	137,592	0.13%
上海聯影醫療	2,495	273,702	0.25%
藥明康德	12,800	501,632	0.46%
片仔癀	2,447	506,945	0.46%
		3,202,849	2.92%
工業			
航發動力	9,580	350,149	0.32%
中航機載	16,060	192,238	0.17%
中航沈飛	5,253	210,645	0.19%
京滬高鐵	167,615	900,093	0.82%
中國船舶	16,813	684,457	0.62%
招商局能源	17,420	147,199	0.13%
中遠海控	35,251	546,038	0.50%
中國中車	69,631	522,929	0.48%
大秦鐵路	52,625	376,795	0.34%
東方電氣	7,190	132,656	0.12%
福萊特玻璃	5,109	102,691	0.09%
福斯特	8,162	119,981	0.11%
恒立液壓	2,962	137,970	0.13%
中天科技	17,780	281,813	0.26%
晶科能源	21,971	155,994	0.14%
隆基綠能科技	41,812	586,204	0.53%
明陽智能	13,915	131,358	0.12%
國電南瑞	26,390	658,694	0.60%
德業股份	1,342	99,764	0.09%
寧波港	30,253	102,860	0.09%
三一重工	39,108	645,282	0.59%
上海電氣	32,701	120,994	0.11%
上港集團	22,136	127,946	0.12%
璞泰來	5,765	81,459	0.08%
特變電工	27,481	381,162	0.35%
通威股份	16,856	322,118	0.29%
天合光能	8,909	150,740	0.14%
圓通速遞	16,676	260,979	0.24%
正泰電器	7,363	140,339	0.13%
時代電氣	2,167	107,006	0.10%
		8,778,553	8.00%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股通低碳指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
資訊科技業			
三六零	24,641	189,243	0.17%
中微公司	2,892	408,524	0.37%
金山辦公	1,742	396,305	0.36%
寒武紀科技	849	168,671	0.15%
中國通號	15,487	92,922	0.09%
華潤微	2,833	106,067	0.10%
中科曙光	9,464	392,756	0.36%
工業富聯	26,468	725,223	0.66%
兆易創新	5,474	523,424	0.48%
士蘭微	5,626	98,511	0.09%
恒生電子	11,265	198,940	0.18%
海光信息	7,947	558,833	0.51%
長電科技	10,047	318,590	0.29%
瀾起科技	7,027	401,663	0.36%
滬矽產業	10,262	141,718	0.13%
三安光電	20,120	235,806	0.22%
中芯國際	11,531	531,579	0.48%
實信軟件	5,761	183,949	0.17%
傳音控股	4,738	362,646	0.33%
斯達半導	761	65,530	0.06%
上海韋爾半導體	6,366	632,589	0.58%
聞泰科技	6,342	179,162	0.16%
用友網絡	14,242	142,420	0.13%
		7,055,071	6.43%
原材料業			
寶山鋼鐵	46,183	307,117	0.28%
中國巨石	15,145	167,352	0.15%
中國化學	24,927	205,399	0.19%
洛陽鉬業	50,654	430,559	0.39%
合盛鈾業	1,844	86,133	0.08%
寶豐能源	13,222	229,137	0.21%
山東黃金	10,117	277,003	0.25%
華魯恒升	9,071	241,651	0.22%
南山鋁業	38,392	146,274	0.13%
三棵樹	1,166	42,291	0.04%
萬華化學	10,436	843,855	0.77%
大全能源	3,230	65,860	0.06%
華友鈷業	8,524	188,636	0.17%
紫金礦業	96,562	1,696,594	1.55%
		4,927,861	4.49%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股通低碳指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
地產建築業			
安徽海螺水泥	12,717	299,994	0.27%
中國交通建設	15,044	134,493	0.12%
中國中鐵	58,272	379,933	0.35%
中國鐵建	28,913	247,784	0.23%
保利發展	67,777	593,727	0.54%
四川路橋	15,305	120,756	0.11%
		1,776,687	1.62%
電訊業			
中國移動	4,798	515,785	0.47%
中國衛通集團	4,020	56,642	0.05%
中國電信	96,264	592,023	0.54%
中國聯通	88,483	415,870	0.38%
		1,580,320	1.44%
公用事業			
中國核能電力	59,953	639,099	0.58%
三峽能源	81,310	354,511	0.32%
中國長江電力	79,311	2,293,674	2.09%
華能水電	11,292	121,728	0.11%
川投能源	12,192	228,600	0.21%
		3,637,612	3.31%
深圳證券交易所上市股票			
非必需性消費			
比亞迪	5,694	1,424,924	1.30%
長安汽車	32,073	430,740	0.39%
分眾傳媒	77,033	466,820	0.43%
珠海格力電器	32,499	1,274,611	1.16%
華利集團	1,112	67,665	0.06%
德賽西威	1,427	124,277	0.11%
芒果超媒	6,913	144,482	0.13%
美的集團－A股	32,385	2,088,833	1.90%
TCL科技	115,565	499,241	0.46%
蘇泊爾	1,021	51,152	0.05%
		6,572,745	5.99%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股通低碳指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
必需性消費			
古井貢酒	984	207,693	0.19%
海大集團	5,238	246,448	0.22%
溫氏股份	35,607	705,731	0.64%
雙匯發展	6,493	154,339	0.14%
洋河股份	3,764	303,905	0.28%
瀘州老窖	4,956	711,136	0.65%
牧原股份	15,222	663,679	0.60%
新希望	14,319	130,876	0.12%
宜賓五糧液	12,418	1,590,001	1.45%
益海嘉里	5,097	139,403	0.13%
貝泰妮	1,350	65,232	0.06%
		4,918,443	4.48%
能源業			
東方盛虹	13,923	110,966	0.10%
金融業			
寧波銀行	33,132	730,892	0.67%
東方財富	103,173	1,089,507	0.99%
廣發証券	25,490	310,213	0.28%
國信証券	23,004	199,905	0.18%
同花順	1,785	185,105	0.17%
平安銀行	67,695	687,104	0.63%
申萬宏源	77,700	334,887	0.30%
		3,537,613	3.22%
醫療保健業			
愛爾眼科	33,810	348,919	0.32%
凱萊英	1,409	92,712	0.08%
長春高新	1,913	175,556	0.16%
華潤三九	3,217	136,980	0.12%
智飛生物	8,598	241,002	0.22%
泰格醫藥	4,322	210,049	0.19%
華東醫藥	6,112	169,975	0.16%
華蘭生物	6,328	99,919	0.09%
愛美客	1,024	176,230	0.16%
樂普醫療	8,118	120,471	0.11%
康龍化成	5,994	111,369	0.10%
上海萊士	32,377	253,188	0.23%
邁瑞醫療	4,392	1,277,677	1.16%
沃森生物	10,171	115,746	0.11%
雲南白藥	5,262	269,151	0.25%
新和成	9,801	188,179	0.17%
		3,987,123	3.63%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股通低碳指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
工業			
鵬鼎控股	4,261	169,417	0.15%
中航光電	7,375	280,619	0.26%
中航西飛	8,011	192,504	0.18%
京東方	205,807	841,751	0.77%
三環集團	7,734	225,756	0.21%
招商公路	13,436	159,351	0.13%
振華科技	2,443	101,458	0.09%
中偉股份	2,728	84,541	0.08%
寧德時代	16,803	3,025,044	2.76%
億緯鋰能	8,487	338,801	0.31%
錦浪科技	1,412	58,796	0.05%
歌爾股份	16,389	319,749	0.29%
國軒高科	7,086	135,697	0.12%
天賜材料	7,733	135,791	0.13%
晶澳科技	10,224	114,509	0.10%
先導智能	7,180	119,403	0.11%
藍思科技	16,194	295,541	0.27%
領益智造	17,626	125,497	0.11%
立訊精密工業	29,969	1,178,081	1.07%
順豐控股	14,008	499,946	0.46%
深南電路	1,100	116,347	0.11%
匯川技術	12,919	662,745	0.60%
陽光電源	11,615	720,478	0.66%
邁為股份	967	115,537	0.11%
視源股份	2,810	82,979	0.08%
TCL中環	18,469	159,757	0.15%
濰柴動力	35,282	572,980	0.52%
徐工機械	54,400	388,960	0.35%
三花智控	12,861	245,388	0.22%
中聯重科	40,261	309,205	0.28%
		11,776,628	10.73%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股通低碳指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
資訊科技業			
三七互娛	14,684	191,626	0.18%
華大九天	1,270	97,854	0.09%
廣聯達	11,520	110,362	0.10%
科大訊飛	15,140	650,263	0.59%
北京君正	2,306	127,845	0.12%
浪潮信息	9,042	328,858	0.30%
卓勝微	2,214	172,116	0.16%
北方華創	1,934	618,667	0.56%
納思達	7,466	197,252	0.18%
深信服	2,243	113,339	0.10%
聖邦股份	2,845	235,509	0.22%
中科創達	2,674	121,908	0.11%
紫光股份	14,095	315,023	0.29%
紫光國微	4,601	242,013	0.22%
億聯網絡	4,396	161,641	0.15%
大華股份	13,676	211,431	0.19%
晶盛機電	4,646	133,480	0.12%
中際旭創 – A股	5,754	793,361	0.72%
中興通訊	21,368	597,663	0.54%
		5,420,211	4.94%
原材料業			
中信特鋼	6,572	89,182	0.08%
贛鋒鋰業	7,012	200,894	0.18%
龍佰集團	9,516	176,712	0.16%
鹽湖股份	23,650	412,693	0.38%
榮盛石化	21,380	206,531	0.19%
衛星化學	10,347	186,039	0.17%
天齊鋰業	7,009	209,639	0.19%
恩捷股份	3,853	121,947	0.11%
藏格礦業	7,338	176,626	0.16%
		1,780,263	1.62%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生A股通低 碳指數ETF		
	單位數目	市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
地產建築業			
北新建材	5,536	164,198	0.15%
東方雨虹	11,905	146,908	0.13%
招商蛇口	20,715	182,085	0.17%
萬科企業	52,470	363,617	0.33%
華僑城A	28,669	58,485	0.05%
天山股份	9,944	53,698	0.05%
		968,991	0.88%
公用事業			
中國廣核電力	38,941	180,297	0.17%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資				恒生A股通低碳指數ETF	
				市值 (人民幣)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
按公平價值列入收入或虧損的金融資產					
遠期合約					
外匯遠期合約					
買入	賣出	結算日期	交易對手		
215,326港元	200,438人民幣	2024年7月5日	香港上海滙豐銀行有限公司	706	0.00%
1,231人民幣	1,317港元	2024年7月5日	香港上海滙豐銀行有限公司	1	0.00%
				707	0.00%
按公平價值列入收入或虧損的金融資產總值				110,367,495	100.55%
按公平價值列入收入或虧損的金融負債					
遠期合約					
外匯遠期合約					
買入	賣出	結算日期	交易對手		
1,412人民幣	1,513港元	2024年7月5日	香港上海滙豐銀行有限公司	(2)	(0.00%)
1,236人民幣	1,326港元	2024年7月5日	香港上海滙豐銀行有限公司	(3)	(0.00%)
1,284人民幣	1,376港元	2024年7月5日	香港上海滙豐銀行有限公司	(2)	(0.00%)
按公平價值列入收入或虧損的金融負債總值				(7)	(0.00%)
總投資市值				110,367,488	100.55%
(總投資成本 – 122,209,034人民幣)					
其他負債淨值				(599,164)	(0.55%)
屬於單位持有人之資產淨值				109,768,324	100.00%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
芝加哥期權交易所上市股票 金融 CBOE全球市場	72	12,244	0.04%
納斯達克交易所上市股票 通訊服務 Alphabet	7,692	1,405,537	4.20%
Charter Communications Inc	68	20,329	0.06%
康卡斯特	2,784	109,021	0.33%
美商藝電公司	172	23,965	0.07%
福斯公司	254	8,502	0.03%
Match Group Inc	195	5,924	0.02%
Meta Platforms Inc	1,567	790,113	2.36%
網飛公司	308	207,863	0.62%
新聞集團	369	10,245	0.03%
派拉蒙全球	296	3,075	0.01%
Take-Two互動軟體公司	117	18,192	0.05%
T-Mobile美國公司	365	64,306	0.19%
華納兄弟探索公司	1,578	11,740	0.04%
		2,678,812	8.01%
非必需消費 愛彼迎公司	314	47,612	0.14%
Amazon.com Inc	6,547	1,265,208	3.78%
繽客控股公司	24	95,076	0.28%
凱撒娛樂公司	163	6,478	0.02%
電子灣拍賣網站公司	358	19,232	0.06%
Etsy公司	82	4,836	0.02%
智遊網集團公司	96	12,095	0.04%
孩之寶	95	5,558	0.02%
LKQ Corp	173	7,195	0.02%
露露檸檬公司	82	24,493	0.07%
萬豪國際集團(馬里蘭)	173	41,826	0.12%
奧賴利汽車公司	42	44,354	0.13%
普爾公司	29	8,912	0.03%
Ross Stores Inc	241	35,022	0.10%
星巴克	801	62,358	0.19%
Tesla Inc	1,979	391,604	1.17%
曳引車供應公司	77	20,790	0.06%
Ulta Beauty Inc	34	13,120	0.04%
永利度假村有限公司	74	6,623	0.02%
		2,112,392	6.31%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
必需消費			
好市多	318	270,297	0.81%
錢樹商店	146	15,588	0.05%
克里格胡椒博士公司	743	24,816	0.07%
卡夫亨氏公司	550	17,721	0.05%
億滋國際	949	62,103	0.19%
怪獸飲料公司	520	25,974	0.08%
百事可樂	982	161,961	0.48%
沃博聯公司	534	6,459	0.02%
		584,919	1.75%
能源			
阿帕奇公司	281	8,273	0.03%
貝克休斯公司	706	24,830	0.07%
Diamondback Energy Inc	129	25,825	0.08%
		58,928	0.18%
金融			
艾奇資本集團有限公司	269	27,139	0.08%
辛辛那提金融公司	106	12,518	0.04%
芝加哥商品期貨交易所集團	253	49,740	0.15%
五三銀行	485	17,698	0.05%
杭庭頓	1,064	14,023	0.04%
Jack Henry & Associates Inc	55	9,131	0.03%
MarketAxess Holdings Inc	30	6,016	0.02%
納斯達克有限公司	272	16,391	0.05%
北方信託公司	154	12,933	0.04%
Paypal控股有限公司	759	44,045	0.13%
信安金融保險集團	157	12,317	0.03%
普徠仕集團公司	165	19,026	0.06%
威利斯韜睿惠悅公司	73	19,136	0.06%
		260,113	0.78%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
健康護理			
艾利科技公司	53	12,796	0.04%
安進公司	381	119,043	0.36%
生物基因公司	105	24,341	0.07%
Bio-Techne Corp	114	8,168	0.02%
Cooper Cos Inc/The	150	13,095	0.04%
DexCom公司	285	32,313	0.10%
GE HealthCare Technologies Inc	312	24,311	0.07%
吉利德科學公司	881	60,445	0.18%
漢瑞祥公司	102	6,538	0.02%
Hologic Inc	168	12,474	0.04%
IDEXX Laboratories Inc	58	28,258	0.08%
英賽德公司	132	8,002	0.02%
Insulet Corp	53	10,695	0.03%
直覺外科公司	255	113,437	0.34%
摩德納公司	239	28,381	0.09%
Regeneron Pharmaceuticals Inc	76	79,878	0.24%
福泰製藥公司	186	87,182	0.26%
暉致公司	901	9,578	0.03%
		678,935	2.03%
工業			
美國航空集團	505	5,722	0.02%
自動資料處理公司	295	70,414	0.21%
泰瑟國際公司	54	15,889	0.05%
羅賓昇國際聯運股份有限公司	89	7,843	0.02%
信達思公司	63	44,116	0.13%
科派特公司	630	34,121	0.10%
CSX Corp	1,416	47,365	0.14%
快扣有限公司	420	26,393	0.08%
漢威聯合國際公司	468	99,937	0.30%
J.B. Hunt Transport Services Inc	61	9,760	0.03%
諾信公司	43	9,973	0.03%
Old Dominion Freight Line Inc	131	23,135	0.07%
帕卡公司	377	38,808	0.12%
Paychex Inc	235	27,862	0.08%
聯合航空控股公司	219	10,657	0.03%
Verisk Analytics Inc	104	28,033	0.09%
		500,028	1.50%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
資訊科技			
奧多比系統公司	321	178,328	0.53%
超微半導體公司	1,155	187,353	0.56%
Akamai Technologies Inc	112	10,089	0.03%
亞德諾公司	354	80,804	0.24%
ANSYS Inc	64	20,576	0.06%
蘋果公司	10,302	2,169,807	6.49%
Applied Materials Inc	594	140,178	0.42%
歐特克	151	37,365	0.11%
Broadcom Inc	311	499,320	1.49%
Cadence設計系統公司	192	59,088	0.18%
CDW Corp/DE	100	22,384	0.07%
思科系統	2,879	136,781	0.41%
高知特科技公司	357	24,276	0.07%
Crowdstrike控股公司	163	62,460	0.19%
Enphase能源公司	103	10,270	0.03%
F5 Inc	46	7,923	0.02%
First Solar Inc	76	17,135	0.05%
防特網公司	457	27,543	0.08%
Gen Digital Inc	396	9,892	0.03%
英特爾	3,042	94,211	0.28%
直覺公司	201	132,099	0.39%
科磊公司	96	79,153	0.24%
科林研發股份有限公司	93	99,031	0.30%
微芯科技公司	382	34,953	0.10%
美光科技公司	791	104,040	0.31%
微軟	5,312	2,374,198	7.10%
芯源系統有限公司	35	28,759	0.09%
網路應用公司	153	19,706	0.06%
NVIDIA Corp	17,576	2,171,339	6.49%
恩智浦半導體股份有限公司	181	48,705	0.15%
安森美半導體	312	21,388	0.06%
Palo Alto Networks Inc	233	78,989	0.24%
參數科技公司	87	15,805	0.05%
科沃公司	72	8,355	0.03%
高通公司	799	159,145	0.48%
Roper科技公司	77	43,402	0.13%
希捷科技控股公開有限公司	141	14,561	0.04%
思佳訊半導體有限公司	118	12,576	0.04%
超微電腦公司	35	28,677	0.09%
新思科技公司	108	64,267	0.19%
泰瑞達公司	108	16,015	0.05%
德州儀器公司	651	126,639	0.38%
天寶公司	191	10,681	0.03%
維聖公司	60	10,668	0.03%
威騰電子公司	235	17,806	0.05%
斑馬科技公司	36	11,122	0.03%
		9,527,862	28.49%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
物料			
New Linde Plc	342	150,073	0.45%
Steel Dynamics	105	13,598	0.04%
		163,671	0.49%
房地產			
科斯塔集團公司	297	22,019	0.07%
公用事業			
Alliant Energy Corp	183	9,315	0.03%
美國電力公司	376	32,990	0.10%
Constellation Energy Corp	228	45,662	0.14%
Evergy公司	174	9,217	0.03%
愛克斯龍公司	717	24,815	0.07%
Xcel Energy Inc	397	21,204	0.06%
		143,203	0.43%
紐約交易所上市股票			
通訊服務			
AT&T公司	5,123	97,901	0.29%
Live Nation Entertainment Inc	101	9,468	0.03%
奧姆尼康集團	138	12,379	0.04%
埃培智集團	275	8,000	0.02%
威瑞森電信公司	3,008	124,050	0.37%
華特迪士尼公司	1,303	129,375	0.39%
		381,173	1.14%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
非必需消費			
安波福公開有限公司	200	14,084	0.04%
汽車地帶公司	12	35,569	0.11%
Bath & Body Works Inc	171	6,677	0.02%
Best Buy	131	11,042	0.03%
博格華納	183	5,900	0.02%
CarMax Inc	111	8,141	0.02%
嘉年華集團	704	13,179	0.04%
奇波雷墨西哥燒烤公司	981	61,460	0.18%
DR Horton Inc	214	30,159	0.09%
達登餐廳	85	12,862	0.04%
德克斯戶外用品公司	19	18,391	0.05%
達美樂披薩股份有限公司	26	13,425	0.04%
福特汽車公司	2,856	35,814	0.11%
國際航電股份有限公司	115	18,736	0.06%
通用汽車公司	830	38,562	0.11%
純正零件公司	96	13,279	0.04%
希爾頓全球控股公司	177	38,621	0.12%
Home Depot Inc	708	243,722	0.73%
拉斯維加斯金沙集團	270	11,948	0.04%
萊納房屋公司	173	25,927	0.08%
羅威	409	90,168	0.27%
麥當勞公司	514	130,988	0.39%
美高梅度假村國際	164	7,288	0.02%
Mohawk Industries Inc	39	4,430	0.01%
耐克	859	64,743	0.19%
挪威郵輪控股有限公司	291	5,468	0.02%
NVR Inc	2	15,177	0.05%
普得集團公司	152	16,735	0.05%
雷夫羅倫公司	31	5,427	0.02%
皇家加勒比國際游輪	173	27,581	0.08%
TPR-DRS-RS	162	6,932	0.02%
TJX Cos Inc	815	89,732	0.27%
百勝餐飲	202	26,757	0.08%
		1,148,924	3.44%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
必需消費			
高特利集團	1,229	55,981	0.17%
Archer-Daniels-Midland Co	354	21,399	0.06%
百富門公司	129	5,571	0.02%
邦吉有限公司	95	10,143	0.03%
金寶湯公司	142	6,417	0.02%
丘奇及德懷特公司	169	17,522	0.05%
高樂氏公司	88	12,009	0.04%
可口可樂	2,770	176,311	0.53%
高露潔-棕欖公司	593	57,545	0.17%
康尼格拉食品公司	342	9,720	0.03%
星座公司	115	29,587	0.09%
一元雜貨	155	20,496	0.06%
雅詩蘭黛	167	17,769	0.05%
通用磨坊	403	25,494	0.08%
霍梅爾食品	206	6,281	0.02%
J. M. Smucker	78	8,505	0.02%
Kellanova	183	10,555	0.03%
Kenvue Inc	1,354	24,616	0.07%
金百利克拉克	238	32,892	0.10%
克羅格	466	23,267	0.07%
藍威斯頓控股公司	104	8,744	0.03%
麥科明克公司(馬里蘭州)	183	12,982	0.04%
摩紳庫爾斯飲料公司	141	7,167	0.02%
菲利浦莫里斯國際公司	1,111	112,578	0.34%
Procter & Gamble	1,686	278,055	0.83%
西斯柯公司	352	25,129	0.07%
目標百貨公司	331	49,001	0.15%
好時公司	107	19,670	0.06%
泰森食品	200	11,428	0.03%
沃爾瑪公司	3,055	206,854	0.62%
		1,303,688	3.90%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
能源			
Chevron Corp	1,225	191,615	0.57%
康菲石油	829	94,821	0.28%
科特拉能源公司	513	13,682	0.04%
戴文能源	443	20,998	0.06%
依歐格資源	411	51,733	0.16%
EQT Corp	333	12,314	0.04%
Exxon Mobil Corp	3,200	368,384	1.10%
哈里伯頓公司	616	20,809	0.06%
赫斯公司	197	29,061	0.09%
金德摩根公司(德拉瓦州)	1,353	26,884	0.08%
馬拉松石油公司	426	12,213	0.04%
Marathon Petroleum Corporation	256	44,411	0.13%
西方石油	474	29,876	0.09%
ONEOK Inc	415	33,843	0.10%
Phillips 66	308	43,480	0.13%
施蘭卜吉	1,035	48,831	0.15%
Targa Resources Corp	164	21,120	0.06%
瓦勒羅能源	234	36,682	0.11%
威廉斯公司	862	36,635	0.11%
		1,137,392	3.40%
金融			
美國家庭人壽保險公司	370	33,045	0.10%
全州保險	189	30,176	0.09%
美國運通	403	93,315	0.28%
美國國際集團	475	35,264	0.11%
阿默普萊斯金融公司	70	29,903	0.09%
怡安公開有限公司	155	45,505	0.14%
Arthur J Gallagher & Co	155	40,193	0.12%
安信龍公司	38	6,318	0.02%
美國銀行	4,861	193,322	0.58%
紐約梅隆銀行	529	31,682	0.10%
Berkshire Hathaway Inc	1,292	525,586	1.57%
貝萊德公司	101	79,519	0.24%
黑石公司	516	63,881	0.19%
Brown & Brown Inc	171	15,289	0.05%
第一資本金融公司	270	37,382	0.11%
嘉信理財	1,055	77,743	0.23%
丘博有限公司	290	73,973	0.22%
花旗集團	1,374	87,194	0.26%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
公民金融集團公司	333	11,998	0.04%
Corpay Inc	50	13,321	0.04%
發現金融服務公司	175	22,892	0.07%
Everest Re Group Ltd	31	11,812	0.03%
FactSet Research Systems Inc	26	10,615	0.03%
富達全國資訊服務	398	29,993	0.09%
Fiserv Inc	419	62,448	0.19%
富蘭克林資源公司	216	4,827	0.01%
環匯公司	176	17,019	0.05%
環球人壽公司	53	4,361	0.01%
高盛集團	230	104,033	0.31%
哈特福德金融服務集團	215	21,616	0.06%
洲際交易所	415	56,809	0.17%
景順有限公司	325	4,862	0.01%
摩根大通	2,055	415,644	1.24%
科凱國際集團	660	9,379	0.03%
科爾伯格-克拉維斯-羅伯茨公司	476	50,094	0.15%
洛斯公司	130	9,716	0.03%
M&T Bank Corp	115	17,406	0.05%
馬什麥克倫南	352	74,173	0.22%
Mastercard Inc	588	259,402	0.78%
大都會人壽	428	30,041	0.09%
穆迪	114	47,986	0.14%
摩根士丹利	894	86,888	0.26%
明晟公司	56	26,978	0.08%
PNC金融服務集團	281	43,690	0.13%
Progressive Corp	415	86,200	0.26%
保德信金融	258	30,235	0.09%
Raymond James Financial Inc	128	15,822	0.05%
區域金融公司	661	13,246	0.04%
標準普爾全球公司	229	102,134	0.31%
道富銀行	217	16,058	0.05%
同步金融	290	13,685	0.04%
旅行者保險公司	167	33,958	0.10%
Truist Financial Corp	955	37,102	0.11%
美國合眾銀行	1,103	43,789	0.13%
Visa Inc	1,127	295,804	0.88%
W R Berkley Corp	146	11,473	0.03%
富國銀行	2,480	147,287	0.44%
		3,794,086	11.34%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
健康護理			
雅培	1,237	128,537	0.38%
艾伯維公司	1,258	215,772	0.65%
安捷倫科技公司	207	26,833	0.08%
Baxter International Inc	360	12,042	0.04%
必帝公司	204	47,677	0.14%
伯瑞股份有限公司	15	4,097	0.01%
波士頓科學公司	1,059	81,554	0.24%
百時美施貴寶公司	1,439	59,762	0.18%
嘉德諾健康集團	173	17,009	0.05%
康泰倫特公司	127	7,141	0.02%
Cencora Inc	117	26,360	0.08%
聖丁公司	376	24,929	0.07%
查爾斯河實驗室國際公司	40	8,263	0.02%
CVS Health Corp	888	52,445	0.16%
丹納赫集團	474	118,429	0.35%
德維特公司	39	5,404	0.02%
愛德華生命科學	434	40,089	0.12%
Elevance Health Inc	165	89,407	0.27%
Eli Lilly & Co	571	516,972	1.55%
HCA Healthcare Inc	139	44,658	0.13%
哈門那公司	84	31,387	0.09%
IQVIA控股公司	133	28,121	0.08%
Johnson & Johnson	1,716	250,811	0.75%
徠博科控股公司	61	12,414	0.04%
麥卡遜	94	54,900	0.16%
美敦力公司	957	75,325	0.23%
默克藥廠	1,815	224,697	0.67%
Mettler-Toledo國際公司	15	20,964	0.06%
莫利納醫療保健公司	40	11,892	0.04%
輝瑞大藥廠股份有限公司	4,007	112,116	0.34%
奎斯特診斷公司	84	11,498	0.03%
瑞斯邁股份有限公司	102	19,525	0.06%
Revvity Inc	94	9,857	0.03%
Solventum Corp	112	5,922	0.02%
STERIS公開有限公司	70	15,368	0.05%
史賽克	244	83,021	0.25%
Teleflex Inc	36	7,572	0.02%
信諾公司	201	66,445	0.20%
賽默飛世爾科技有限公司	273	150,969	0.45%
UnitedHealth Group Inc	656	334,074	1.00%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
環球健康服務公司	41	7,582	0.02%
沃特斯公司	40	11,605	0.03%
West Pharmaceutical Services Inc	50	16,470	0.05%
捷邁邦美控股公司	149	16,171	0.05%
碩騰股份有限公司	322	55,822	0.17%
		3,161,908	9.45%
工業			
3M	398	40,672	0.12%
A.O. 史密斯公司	92	7,524	0.02%
安朗杰有限公司	67	7,916	0.02%
得邁斯	169	28,174	0.08%
波音	414	75,352	0.23%
Broadridge Financial Solutions	88	17,336	0.05%
Builders FirstSource Inc	93	12,872	0.04%
開利全球公司	603	38,037	0.11%
卡特彼勒公司	351	116,918	0.35%
康明斯公司	99	27,416	0.08%
Dayforce Inc	123	6,101	0.02%
迪爾	187	69,869	0.21%
達美航空	478	22,676	0.07%
多佛公司	102	18,406	0.05%
伊頓公開有限公司	288	90,302	0.27%
艾默生電氣	410	45,166	0.12%
易速傳真公司	90	21,821	0.07%
Expeditors International of Washington	105	13,103	0.04%
聯邦快遞	164	49,174	0.15%
Fortive Corp	259	19,192	0.06%
奇異維諾瓦公司	197	33,787	0.10%
基內瑞克控股公司	49	6,479	0.02%
通用動力公司	165	47,873	0.14%
通用電氣公司	786	124,950	0.37%
Howmet航太公司	282	21,892	0.07%
安柏	41	14,985	0.04%
Huntington Ingalls Industries	29	7,144	0.02%
IDEX Corp	58	11,670	0.03%
伊利諾工具公司	195	46,207	0.14%
英格索蘭公司	296	26,889	0.08%
Jacobs Solutions Inc	93	12,993	0.04%
江森自控國際公司	492	32,703	0.10%
L3 哈里斯科技公司	137	30,767	0.09%
雷多斯控股公司	101	14,734	0.04%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
馬斯可	167	11,134	0.03%
諾福克南方公司	165	35,424	0.11%
諾斯洛普格拉曼	100	43,595	0.13%
奧的斯電梯公司	296	28,493	0.09%
派克漢尼汾公司	92	46,534	0.14%
Paycom軟體公司	38	5,436	0.02%
濱特爾公開有限公司	123	9,430	0.03%
廣達服務公司	106	26,934	0.08%
共和服務公司	149	28,957	0.09%
洛克威爾自動化公司	84	23,123	0.07%
羅林斯公司	208	10,148	0.03%
雷神科技公司	956	95,973	0.29%
實耐實公司	41	10,717	0.03%
西南航空	450	12,875	0.04%
史丹利百得公司	114	9,107	0.03%
德事隆公司	147	12,621	0.04%
特靈科技公開有限公司	164	53,944	0.16%
TransDigm Group Inc	40	51,104	0.15%
優步科技公司	1,502	109,165	0.33%
聯合太平洋公司	439	99,328	0.30%
聯合包裹服務公司	526	71,983	0.22%
聯合租賃公司	49	31,690	0.09%
Veralto Corp	167	15,943	0.05%
格雷杰公司	32	28,872	0.09%
西屋空氣制動技術公司	129	20,388	0.06%
Waste Management Inc	264	56,322	0.17%
Xylem Inc	176	23,871	0.07%
		2,134,211	6.38%
資訊科技			
埃森哲有限公司	449	136,231	0.41%
安費諾	849	57,197	0.17%
Arista網路公司	178	62,386	0.19%
康寧公司	550	21,368	0.06%
億磐系統公司	39	7,336	0.02%
Fair Isaac Corp	18	26,796	0.08%
高德納公司	56	25,147	0.07%
GoDaddy Inc	96	13,412	0.04%
慧與	929	19,667	0.06%
惠普	623	21,818	0.07%
國際商業機器公司	656	113,455	0.34%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
捷普公司	86	9,356	0.03%
瞻博網路	226	8,240	0.02%
是德科技公司	125	17,094	0.05%
摩托羅拉系統公司	121	46,712	0.14%
甲骨文公司	1,139	160,827	0.48%
Salesforce Inc	694	178,427	0.53%
ServiceNow Inc	146	114,854	0.34%
TE Connectivity Ltd	219	32,944	0.10%
得立達科技公司	33	12,803	0.04%
Tyler Technologies Inc	29	14,581	0.04%
		1,100,651	3.28%
物料			
Air Products and Chemicals Inc	159	41,030	0.12%
雅保公司	81	7,737	0.02%
安姆科公開有限公司	1,079	10,553	0.03%
艾利丹尼森	58	12,682	0.04%
包爾公司	225	13,505	0.04%
塞拉尼斯公司	70	9,442	0.03%
CF Industries Holdings Inc	132	9,784	0.03%
科迪華公司	481	25,945	0.08%
陶氏	504	26,737	0.08%
新杜邦公司	288	23,181	0.07%
伊士曼化學有限公司	88	8,621	0.04%
藝康集團	182	43,316	0.13%
FMC Corp	77	4,431	0.01%
自由港麥克莫蘭銅金公司	1,026	49,863	0.15%
International Flavors & Fragrance	189	17,995	0.05%
國際紙業	264	11,392	0.03%
利安德巴塞爾工業公司	185	17,697	0.05%
Martin Marietta Materials Inc	45	24,381	0.07%
美盛公司	205	5,925	0.02%
紐蒙特公司	833	34,878	0.10%
諾可公司	167	26,399	0.08%
美國包裝公司	61	11,136	0.03%
匹茲堡工業	169	21,275	0.06%
宣偉	169	50,435	0.15%
瓦爾坎材料公司	95	23,624	0.07%
西岩公司	172	8,645	0.04%
		540,609	1.62%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
房地產			
BXP, Inc	104	6,402	0.02%
世邦魏理仕集團公司	217	19,337	0.06%
金克不動產公司	450	8,757	0.02%
公共存儲公司	115	33,080	0.10%
賽門物業集團	238	36,128	0.11%
UDR Inc	233	9,588	0.03%
		113,292	0.34%
公用事業			
愛伊公司	498	8,750	0.03%
阿莫林公司	191	13,582	0.04%
美國水處理公司	139	17,953	0.05%
Atmos Energy Corp	107	12,482	0.04%
CenterPoint能源	457	14,158	0.04%
CMS Energy Corp	205	12,204	0.04%
聯合愛迪生	247	22,087	0.07%
道明尼能源公司	601	29,449	0.09%
DTE Energy Co	149	16,540	0.05%
Duke Energy Corp	552	55,327	0.16%
愛迪生國際	279	20,035	0.06%
安特吉公司	149	15,943	0.05%
Eversource Energy	249	14,121	0.04%
FirstEnergy Corp	366	14,007	0.04%
NextEra Energy Inc	1,468	103,949	0.31%
NiSource公司	313	9,017	0.03%
NRG Energy Inc	157	12,224	0.04%
太平洋電力瓦斯	1,527	26,661	0.08%
皮那可資本公司	81	6,187	0.02%
PPL Corp	528	14,599	0.04%
大眾服務企業集團	356	26,237	0.08%
Sempra	450	34,227	0.10%
南方公司	781	60,582	0.18%
維斯達能源公司	233	20,033	0.06%
WEC Energy Group Inc	226	17,732	0.05%
		598,086	1.79%
權益總值		32,157,146	96.16%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資	恒生標普500指數ETF		
	單位數目	市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
集體投資計劃			
納斯達克交易所上市股票			
房地產			
Equinix REIT	69	52,205	0.15%
Host Hotels & Resorts REIT	544	9,781	0.03%
Regency Centers REIT	109	6,780	0.02%
SBA Communications REIT	80	15,704	0.05%
		84,470	0.25%
紐約交易所上市股票			
房地產			
Alexandria REIT	118	13,802	0.04%
American Tower REIT	337	65,506	0.20%
AvalonBay Communities REIT	103	21,310	0.06%
Camden Property Trust REIT	82	8,947	0.03%
Crown Castle REIT	310	30,287	0.09%
Digital Realty Trust REIT	236	35,884	0.11%
Equity Residential REIT	256	17,751	0.05%
Essex Property Trust REIT	48	13,066	0.04%
Extra Space Storage REIT	151	23,467	0.07%
Healthpeak Property REIT	538	10,545	0.03%
Invitation Homes REIT	430	15,433	0.05%
Iron Mountain REIT	217	19,447	0.06%
Mid-America Apartment Communities REIT	83	11,837	0.04%
Prologis REIT	655	73,563	0.22%
Realty Income Corporation REIT	623	32,907	0.10%
Ventas REIT	280	14,353	0.04%
VICI Properties REIT	769	22,024	0.06%
Welltower REIT	428	44,619	0.13%
Weyerhaeuser REIT	544	15,444	0.05%
		490,192	1.47%
集體投資計劃總值		574,662	1.72%

投資組合 (未經審核) (續)

2024年6月30日

投資						恒生標普500指數ETF	
						市值 (美元)	佔屬於單位 持有人之 資產淨值百分比
按公平價值列入收入或虧損的金融資產							
遠期合約							
外匯遠期合約							
買入	賣出	結算日期	交易對手				
USD5,695	CNH41,459	05/07/2024	香港上海滙豐銀行有限公司			14	0.00%
						14	0.00%
期貨合約							
標的資產	合約大小	名義市場價值	倉位	交易對手			
E-迷你標普500期貨-2024年9月	E-迷你標普500	29	800,618	長倉	香港上海滙豐銀行有限公司	2,784	0.01%
						2,784	0.01%
按公平價值列入收入或虧損的金融資產總值						32,734,606	97.89%
按公平價值列入收入或虧損的金融負債							
遠期合約							
外匯遠期合約							
買入	賣出	結算日期	交易對手				
CNH6,931,355	USD954,468	05/07/2024	香港上海滙豐銀行有限公司			(4,811)	(0.01%)
CNH741,000	USD101,807	05/07/2024	香港上海滙豐銀行有限公司			(283)	(0.00%)
CNH292,500	USD40,186	05/07/2024	香港上海滙豐銀行有限公司			(111)	(0.00%)
CNH42,309	USD5,800	05/07/2024	香港上海滙豐銀行有限公司			(4)	(0.00%)
						(5,209)	(0.01%)
按公平價值列入收入或虧損的金融負債總值						(5,209)	(0.01%)
總投資市值						32,729,397	97.88%
(總投資成本 – 30,766,855美元)							
其他資產淨值						710,443	2.12%
屬於單位持有人之資產淨值						33,439,840	100.00%

投資組合變動表 (未經審核)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股行業龍頭指數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
上海證券交易所上市股票				
非必需性消費				
海爾智家	84,100	8,200	21,226	71,074
上汽集團	64,900	5,400	16,278	54,022
必需性消費				
海天味業	43,200	8,100	14,814	36,486
內蒙古伊利實業	134,000	13,500	33,930	113,570
貴州茅臺酒	8,200	1,800	1,910	8,090
能源業				
中國石油化工	421,500	32,700	180,516	273,684
中國神華能源	72,245	7,300	17,580	61,965
中國石油天然氣	251,900	23,500	62,950	212,450
陝西煤業	75,400	8,800	20,606	63,594
兗礦能源	25,550	2,000	5,924	21,626
金融業				
中國農業銀行	699,597	73,700	173,588	599,709
中國銀行	468,300	50,900	124,286	394,914
中國建設銀行	149,300	14,000	37,116	126,184
中國工商銀行	890,308	91,800	222,398	759,710
中國平安保險	202,700	44,400	54,976	192,124
醫療保健業				
江蘇恒瑞醫藥	91,905	9,000	23,006	77,899
上海復星醫藥	28,300	4,400	8,990	23,710
藥明康德	48,356	5,500	15,656	38,200
工業				
中遠海控	128,200	12,000	32,622	107,578
隆基綠能科技	142,800	13,400	35,452	120,748
資訊科技業				
工業富聯	88,300	8,700	22,376	74,624
中芯國際	41,652	3,774	10,222	35,204
上海韋爾半導體	17,105	2,000	4,250	14,855
原材料業				
寶山鋼鐵	173,200	15,200	42,880	145,520
恒力石化	39,100	10,500	9,804	39,796
萬華化學	38,300	3,600	9,492	32,408
紫金礦業	342,100	34,600	86,604	290,096

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股行業龍頭指數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
地產建築業				
安徽海螺水泥	48,900	4,000	11,620	41,280
中國交通建設	52,700	7,300	15,446	44,554
中國中鐵	205,500	19,100	50,876	173,724
中國建築	419,160	38,700	106,946	350,914
電訊業				
中國移動	16,700	1,500	3,818	14,382
中國衛通集團	14,100	600	2,642	12,058
中國電信	345,000	31,900	86,016	290,884
中國聯通	318,000	29,300	78,404	268,896
公用事業				
中國核能電力	167,900	35,900	44,582	159,218
三峽能源	318,000	31,500	107,502	241,998
中國長江電力	216,840	47,700	57,620	206,920
華能國電	97,749	8,300	23,940	82,109
深圳證券交易所上市股票				
非必需性消費				
比亞迪	22,100	2,000	7,104	16,996
珠海格力電器	99,800	10,600	25,782	84,618
美的集團	109,000	11,100	28,430	91,670
必需性消費				
牧原食品股份有限公司	72,000	5,300	31,166	46,134
宜賓五糧液	43,000	4,400	10,978	36,422
醫療保健業				
邁瑞醫療	13,500	1,000	3,104	11,396
雲南白藥	17,980	1,200	5,754	13,426
工業				
寧德時代	63,200	6,100	19,704	49,596
立訊精密工業	102,900	10,300	25,580	87,620
順豐控股	48,800	4,500	12,024	41,276
資訊科技業				
杭州海康威視數字技術	82,697	8,500	21,256	69,941
中興通訊	71,600	7,000	18,078	60,522
原材料業				
榮盛石化	78,800	8,400	21,106	66,094
地產建築業				
萬科企業	140,441	13,300	34,992	118,749
公用事業				
中國廣核電力	174,800	16,000	79,532	111,268

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生嘉實滬深300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
深圳證券交易所上市股票				
交易所買賣基金				
嘉實滬深300ETF	13,447,800	-	7,000	13,440,800

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數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
上海證券交易所上市股票				
非必需性消費				
中國國航	23,532	10,900	10,030	24,402
星宇股份	944	400	365	979
中國東方航空	49,309	20,500	23,745	46,064
中國南方航空	27,365	12,600	15,675	24,290
重慶小康	4,602	2,000	1,710	4,892
科沃斯	1,503	800	685	1,618
福耀玻璃	8,833	4,300	3,780	9,353
公牛集團	900	905	500	1,305
長城汽車	7,510	3,500	3,195	7,815
廣汽集團	13,727	6,200	5,985	13,942
海爾智家	27,560	11,500	13,250	25,810
海南航空	148,500	68,200	62,560	154,140
華域汽車	9,029	4,200	3,845	9,384
拓普集團	2,727	1,200	1,410	2,517
歐派家居	1,128	500	440	1,188
上汽集團	18,215	8,300	7,940	18,575
上海機場	6,865	3,200	3,065	7,000
錦江酒店	2,727	1,300	1,225	2,802
晨光股份	2,726	1,600	1,215	3,111
春秋航空	2,600	1,500	1,188	2,912
必需性消費				
迎駕貢酒	—	2,200	664	1,536
重慶啤酒	1,314	600	500	1,414
東鵬飲料	968	400	460	908
海天味業	11,830	6,500	5,990	12,340
內蒙古伊利實業	36,720	17,300	15,610	38,410
今世緣	4,886	2,200	2,404	4,682
貴州茅臺酒	3,632	1,500	1,768	3,364
山西汾酒	3,007	1,400	1,445	2,962
青島啤酒	1,777	800	815	1,762
能源業				
中海油田服務	3,573	1,600	1,470	3,703
中國海油	—	25,700	13,625	12,075

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數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
金融業				
中國農業銀行	256,355	106,100	122,480	239,975
北京銀行	125,259	65,000	55,370	134,889
成都銀行	26,028	8,700	17,115	17,613
中國銀行	152,468	71,500	62,485	161,483
交通銀行	182,919	84,000	82,575	184,344
杭州銀行	24,684	17,600	11,650	30,634
江蘇銀行	110,170	53,300	44,890	118,580
南京銀行	67,932	31,700	59,280	40,352
上海銀行	74,326	36,900	30,525	80,701
中信銀行	24,636	12,800	10,400	27,036
中國建設銀行	50,070	23,300	20,825	52,545
中國光大銀行	205,072	98,300	83,500	219,872
中國銀河	13,954	11,300	7,025	18,229
中金公司	6,222	3,700	2,785	7,137
中國人壽保險	12,323	6,800	5,275	13,848
招商銀行	84,159	38,500	36,285	86,374
招商證券	27,990	11,900	13,105	26,785
中國民生銀行	209,220	99,200	89,785	218,635
中國太保	27,248	12,800	12,165	27,883
浙商銀行	139,164	59,300	64,405	134,059
中信証券	66,792	33,100	28,345	71,547
中信建投證券	15,380	6,600	7,305	14,675
光大證券	14,673	7,700	6,225	16,148
方正證券	28,200	17,900	11,050	35,050
國泰君安	32,105	14,700	12,935	33,870
海通證券	70,944	31,400	35,365	66,979
華泰證券	43,699	20,000	18,650	45,049
華夏銀行	44,363	24,600	22,090	46,873
中國工商銀行	295,359	140,100	131,920	303,539
興業銀行	111,040	57,000	47,880	120,160
興業證券	52,947	23,600	23,255	53,292
新華保險	7,076	3,700	3,000	7,776
東方證券	39,377	18,100	16,775	40,702
中國人保	35,056	16,600	14,300	37,356
中國平安保險	61,881	36,200	26,840	71,241
中國郵政儲蓄銀行	101,612	52,600	42,465	111,747
浦發銀行	131,009	63,000	59,485	134,524
滬農商行	38,903	17,500	17,090	39,313
浙商證券	14,574	8,500	6,465	16,609
中泰證券	22,246	11,200	9,235	24,211

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數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
醫療保健業				
同仁堂	4,414	1,900	1,970	4,344
萬泰生物	2,521	1,100	975	2,646
華熙生物	1,314	677	631	1,360
白雲山	5,015	2,300	2,280	5,035
江蘇恒瑞醫藥	25,478	11,900	10,880	26,498
上海復星醫藥	7,506	4,700	3,220	8,986
君實生物	3,259	–	3,259	–
上海醫藥	–	10,000	2,800	7,200
上海聯影	–	3,436	941	2,495
通策醫療	1,409	–	1,409	–
藥明康德	13,245	6,100	6,545	12,800
片仔癀	2,072	1,300	925	2,447
工業				
航發動力	8,070	4,600	3,090	9,580
中航機載	–	21,700	5,640	16,060
中航沈飛	5,966	2,500	3,213	5,253
京滬高鐵	166,700	74,200	73,285	167,615
中國船舶	15,143	8,200	6,530	16,813
招商輪船	–	23,600	6,180	17,420
中遠海控	34,436	15,600	14,785	35,251
中國中車	67,241	30,900	28,510	69,631
大秦鐵路	35,327	23,700	6,402	52,625
東方電氣	6,900	3,400	3,110	7,190
福萊特玻璃	4,169	2,800	1,860	5,109
福斯特	5,650	4,932	2,420	8,162
弘元綠能	1,771	–	1,771	–
恒立液壓	2,912	1,300	1,250	2,962
中天科技	19,375	7,900	9,495	17,780
晶科能源	12,539	17,717	8,285	21,971
隆基綠能科技	38,532	19,500	16,220	41,812
明陽智能	12,600	6,700	5,385	13,915
國電南瑞	25,395	11,800	10,805	26,390
德業股份	939	783	380	1,342
寧波港	29,478	13,500	12,725	30,253
杉杉股份	8,466	–	8,466	–
三一重工	38,233	17,400	16,525	39,108
上海電氣	29,841	15,300	12,440	32,701
上港集團	22,006	9,800	9,670	22,136
璞泰來	5,575	2,600	2,410	5,765
特變電工	26,911	12,300	11,730	27,481
通威股份	15,991	7,600	6,735	16,856
天合光能	9,399	3,938	4,428	8,909
圓通速遞	15,141	7,900	6,365	16,676
正泰電器	7,338	3,400	3,375	7,363
時代電氣	2,052	960	845	2,167

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數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
資訊科技業				
三六零	20,446	12,600	8,405	24,641
中微公司	2,669	1,313	1,090	2,892
金山辦公	1,346	1,293	897	1,742
寒武紀科技	—	1,683	834	849
中國通號	14,349	6,979	5,841	15,487
華潤微	2,862	1,253	1,282	2,833
中科曙光	8,934	4,200	3,670	9,464
工業富聯	28,498	11,100	13,130	26,468
兆易創新	3,949	3,600	2,075	5,474
士蘭微	5,641	2,900	2,915	5,626
恒生電子	9,770	5,900	4,405	11,265
海光信息	—	10,149	2,202	7,947
長電科技	9,877	4,500	4,330	10,047
瀾起科技	7,096	3,106	3,175	7,027
滬硅產業	9,025	5,014	3,777	10,262
三安光電	20,800	8,900	9,580	20,120
中芯國際	11,089	5,098	4,656	11,531
實信軟件	4,516	3,160	1,915	5,761
傳音控股	2,358	3,444	1,064	4,738
斯達半導	470	546	255	761
上海韋爾半導體	6,694	3,100	3,428	6,366
聞泰科技	6,226	2,900	2,784	6,342
用友網絡	14,202	6,400	6,360	14,242
原材料業				
寶山鋼鐵	44,853	20,400	19,070	46,183
中國巨石	14,765	6,800	6,420	15,145
中國化學	22,662	10,400	8,135	24,927
洛陽鉬業	44,134	25,700	19,180	50,654
合盛矽業	1,784	800	740	1,844
寶豐能源	12,887	5,900	5,565	13,222
山東黃金	9,572	4,500	3,955	10,117
華魯恒升	9,031	4,100	4,060	9,071
南山鋁業	36,582	17,100	15,290	38,392
三棵樹	1,086	500	420	1,166
萬華化學	9,961	4,800	4,325	10,436
大全能源	3,012	1,641	1,423	3,230
華友鈷業	8,019	3,800	3,295	8,524
紫金礦業	92,757	43,100	39,295	96,562

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數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
地產建築業				
安徽海螺水泥	12,227	5,700	5,210	12,717
中國交通建設	15,054	6,700	6,710	15,044
中國中鐵	56,267	25,800	23,795	58,272
中國鐵建	28,968	12,800	12,855	28,913
金地集團	30,901	—	30,901	—
保利發展	64,177	30,300	26,700	67,777
新城控股	5,453	—	5,453	—
四川路橋	10,560	9,200	4,455	15,305
電訊業				
中國移動	4,606	2,300	2,108	4,798
中國衛通集團	4,000	1,800	1,780	4,020
中國電信	92,839	42,600	39,175	96,264
中國聯通	85,403	39,200	36,120	88,483
公用事業				
中國核能電力	51,998	32,300	24,345	59,953
三峽能源	85,420	36,000	40,110	81,310
中國長江電力	57,721	52,300	30,710	79,311
華能水電	10,602	5,100	4,410	11,292
川投能源	7,507	8,400	3,715	12,192
深圳證券交易所上市股票				
非必需性消費				
比亞迪	5,949	2,500	2,755	5,694
長安汽車	28,548	15,800	12,275	32,073
分眾傳媒	79,008	34,100	36,075	77,033
珠海格力電器	31,409	14,700	13,610	32,499
華利集團	1,032	500	420	1,112
德賽西威	1,222	600	395	1,427
芒果超媒	5,548	4,100	2,735	6,913
美的集團－A股	—	45,200	12,815	32,385
TCL科技	105,885	53,400	43,720	115,565
蘇泊爾	1,221	500	700	1,021

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數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
必需性消費				
古井貢酒	844	500	360	984
海大集團	5,173	2,300	2,235	5,238
溫氏股份	34,312	15,800	14,505	35,607
雙匯發展	6,193	2,900	2,600	6,493
洋河股份	3,664	1,700	1,600	3,764
酒鬼酒	1,599	–	1,599	–
瀘州老窖	4,696	2,300	2,040	4,956
牧原股份	19,922	6,900	11,600	15,222
新希望	14,104	6,600	6,385	14,319
宜賓五糧液	11,928	5,700	5,210	12,418
益海嘉里	4,982	2,200	2,085	5,097
貝泰妮	1,045	800	495	1,350
能源業				
東方盛虹	15,603	6,200	7,880	13,923
美錦能源	16,141	–	16,141	–
金融業				
寧波銀行	36,417	15,900	19,185	33,132
東方財富	97,923	46,100	40,850	103,173
廣發証券	24,545	11,300	10,355	25,490
國信証券	28,124	10,300	15,420	23,004
同花順	1,695	800	710	1,785
平安銀行	72,750	30,000	35,055	67,695
申萬宏源	77,580	34,400	34,280	77,700
醫療保健業				
愛爾眼科	33,780	15,000	14,970	33,810
凱萊英	1,414	600	605	1,409
長春高新	1,973	900	960	1,913
華潤三九	–	4,142	925	3,217
智飛生物	8,703	3,500	3,605	8,598
泰格醫藥	4,602	2,100	2,380	4,322
華東醫藥	5,548	3,000	2,436	6,112
華蘭生物	6,098	2,900	2,670	6,328
愛美客	656	713	345	1,024
樂普醫療	7,508	3,800	3,190	8,118
康龍化成	5,398	3,100	2,504	5,994
上海萊士	30,872	14,200	12,695	32,377
邁瑞醫療	4,232	1,900	1,740	4,392
沃森生物	9,756	4,600	4,185	10,171
雲南白藥	5,392	2,300	2,430	5,262
新和成	9,386	4,400	3,985	9,801

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數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				
鵬鼎控股	4,326	2,000	2,065	4,261
中航光電	6,430	3,800	2,855	7,375
中航西飛	8,461	3,600	4,050	8,011
京東方	193,337	91,100	78,630	205,807
三環集團	7,714	3,500	3,480	7,734
招商公路	12,226	6,500	5,290	13,436
振華科技	2,253	1,100	910	2,443
中偉股份	1,999	1,579	850	2,728
寧德時代	17,383	7,500	8,080	16,803
億緯鋰能	8,267	3,800	3,580	8,487
錦浪科技	1,322	600	510	1,412
歌爾股份	14,679	8,000	6,290	16,389
國軒高科	7,076	3,200	3,190	7,086
天賜材料	7,413	3,500	3,180	7,733
晶澳科技	11,139	5,100	6,015	10,224
先導智能	6,585	3,400	2,805	7,180
藍思科技	15,919	7,600	7,325	16,194
領益智造	16,981	7,800	7,155	17,626
立訊精密工業	28,644	13,500	12,175	29,969
順豐控股	13,428	6,400	5,820	14,008
深南電路	1,220	500	620	1,100
德方納米	1,314	—	1,314	—
匯川技術	11,649	6,200	4,930	12,919
陽光電源	7,525	7,318	3,228	11,615
欣旺達	8,352	—	8,352	—
邁為股份	1,032	400	465	967
視源股份	2,260	1,600	1,050	2,810
TCL中環	18,574	8,200	8,305	18,469
濰柴動力	32,592	16,100	13,410	35,282
高德紅外	10,469	—	10,469	—
徐工機械	60,220	26,000	31,820	54,400
金風科技	16,229	—	16,229	—
韻達股份	8,277	—	8,277	—
三花智控	12,426	5,700	5,265	12,861
中聯重科	38,416	17,800	15,955	40,261

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年1月1日至2024年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數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
資訊科技業				
三七互娛	13,584	6,800	5,700	14,684
華大九天	1,200	800	730	1,270
廣聯達	–	16,000	4,480	11,520
科大訊飛	14,015	6,900	5,775	15,140
北京君正	1,886	1,200	780	2,306
浪潮信息	8,232	4,100	3,290	9,042
卓勝微	2,454	1,000	1,240	2,214
北方華創	1,974	900	940	1,934
納思達	5,761	4,600	2,895	7,466
深信服	1,978	1,000	735	2,243
聖邦股份	1,860	2,100	1,115	2,845
中科創達	2,264	1,500	1,090	2,674
紫光股份	10,325	8,500	4,730	14,095
紫光國微	3,945	2,500	1,844	4,601
億聯網絡	4,796	2,000	2,400	4,396
大華股份	13,071	6,100	5,495	13,676
晶盛機電	4,611	2,100	2,065	4,646
中際旭創 – A股	–	7,144	1,390	5,754
中興通訊	19,923	9,700	8,255	21,368
原材料業				
中信特鋼	5,632	2,700	1,760	6,572
贛鋒鋳業	6,572	3,200	2,760	7,012
龍佰集團	8,401	4,800	3,685	9,516
聯泓新科	1,975	–	1,975	–
鹽湖股份	22,740	12,200	11,290	23,650
榮盛石化	20,035	9,600	8,255	21,380
衛星化學	10,062	4,600	4,315	10,347
天齊鋳業	6,674	3,100	2,765	7,009
恩捷股份	3,483	1,900	1,530	3,853
藏格礦業	6,393	3,800	2,855	7,338
地產建築業				
北新建材	5,911	2,700	3,075	5,536
東方雨虹	–	17,200	5,295	11,905
招商蛇口	20,060	9,300	8,645	20,715
萬科企業	48,770	23,600	19,900	52,470
華僑城A	27,729	12,700	11,760	28,669
天山股份	12,469	4,500	7,025	9,944
公用事業				
中國廣核電力	49,396	17,300	27,755	38,941

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
芝加哥期權交易所上市股票				
金融				
CBOE全球市場	—	80	8	72
納斯達克交易所上市股票				
通訊服務				
Alphabet	—	8,251	559	7,692
Charter Communications Inc	—	71	3	68
康卡斯特	—	2,940	156	2,784
美商藝電公司	—	177	5	172
福斯公司	—	254	—	254
Match Group Inc	—	195	—	195
Meta Platforms Inc	—	1,676	109	1,567
網飛公司	—	328	20	308
新聞集團	—	369	—	369
派拉蒙全球	—	419	123	296
Take-Two互動軟體公司	—	124	7	117
T-Mobile美國公司	—	397	32	365
華納兄弟探索公司	—	1,653	75	1,578
非必需消費				
愛彼迎公司	—	319	5	314
Amazon.com Inc	—	6,984	437	6,547
繽客控股公司	—	27	3	24
凱撒娛樂公司	—	163	—	163
電子灣拍賣網站公司	—	405	47	358
Etsy公司	—	82	—	82
智遊網集團公司	—	104	8	96
孩之寶	—	95	—	95
LKQ Corp	—	187	14	173
露露檸檬公司	—	82	—	82
萬豪國際集團(馬里蘭)	—	189	16	173
奧賴利汽車公司	—	43	1	42
普爾公司	—	33	4	29
Ross Stores Inc	—	263	22	241
星巴克	—	856	55	801
Tesla Inc	—	2,104	125	1,979
曳引車供應公司	—	80	3	77
Ulta Beauty Inc	—	40	6	34
永利度假村有限公司	—	74	—	74

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
必需消費				
好市多	—	340	22	318
錢樹商店	—	146	—	146
克里格胡椒博士公司	—	743	—	743
卡夫亨氏公司	—	636	86	550
億滋國際	—	990	41	949
怪獸飲料公司	—	613	93	520
百事可樂	—	1,043	61	982
沃博聯公司	—	534	—	534
能源				
阿帕奇公司	—	331	50	281
貝克休斯公司	—	748	42	706
Diamondback Energy Inc	—	129	—	129
金融				
艾奇資本集團有限公司	—	269	—	269
辛辛那提金融公司	—	128	22	106
芝加哥商品期貨交易所集團	—	265	12	253
五三銀行	—	500	15	485
杭庭頓	—	1,064	—	1,064
Jack Henry & Associates Inc	—	55	—	55
MarketAxess Holdings Inc	—	34	4	30
納斯達克有限公司	—	281	9	272
北方信託公司	—	170	16	154
Paypal控股有限公司	—	807	48	759
信安金融保險集團	—	157	—	157
普徠仕集團公司	—	171	6	165
威利斯韜睿惠悅公司	—	78	5	73

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
健康護理				
艾利科技公司	—	63	10	53
安進公司	—	407	26	381
生物基因公司	—	105	—	105
Bio-Techne Corp	—	114	—	114
Cooper Cos Inc/The	—	158	8	150
Dentsply Siron	—	49	49	—
DexCom公司	—	285	—	285
GE HealthCare Technologies Inc	—	338	26	312
吉利德科學公司	—	925	44	881
漢瑞祥公司	—	124	22	102
Hologic Inc	—	177	9	168
IDEXX Laboratories Inc	—	61	3	58
Illumina	—	128	128	—
英賽德公司	—	143	11	132
Insulet Corp	—	61	8	53
直覺外科公司	—	274	19	255
摩德納公司	—	239	—	239
Regeneron Pharmaceuticals Inc	—	81	5	76
福泰製藥公司	—	200	14	186
暉致公司	—	901	—	901
工業				
美國航空集團	—	505	—	505
自動資料處理公司	—	307	12	295
泰瑟國際公司	—	54	—	54
羅賓昇國際聯運股份有限公司	—	89	—	89
信達思公司	—	67	4	63
科派特公司	—	645	15	630
CSX Corp	—	1,451	35	1,416
快扣有限公司	—	429	9	420
漢威聯合國際公司	—	502	34	468
J.B. Hunt Transport Services Inc	—	61	—	61
諾信公司	—	43	—	43
Old Dominion Freight Line Inc	—	131	—	131
帕卡公司	—	385	8	377
Paychex Inc	—	240	5	235
聯合航空控股公司	—	243	24	219
Verisk Analytics Inc	—	107	3	104

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
資訊科技				
奧多比系統公司	—	345	24	321
超微半導體公司	—	1,227	72	1,155
Akamai Technologies Inc	—	112	—	112
亞德諾公司	—	377	23	354
ANSYS Inc	—	67	3	64
蘋果公司	—	11,051	749	10,302
Applied Materials Inc	—	628	34	594
歐特克	—	155	4	151
Broadcom Inc	—	333	22	311
Cadence設計系統公司	—	206	14	192
CDW Corp/DE	—	104	4	100
思科系統	—	3,029	150	2,879
高知特科技公司	—	386	29	357
Crowdstrike控股公司	—	165	2	163
Enphase能源公司	—	116	13	103
F5 Inc	—	50	4	46
First Solar Inc	—	83	7	76
防特網公司	—	474	17	457
Gen Digital Inc	—	396	—	396
英特爾	—	3,240	198	3,042
直覺公司	—	214	13	201
科磊公司	—	103	7	96
科林研發股份有限公司	—	102	9	93
微芯科技公司	—	391	9	382
美光科技公司	—	837	46	791
微軟	—	5,661	349	5,312
芯源系統有限公司	—	42	7	35
網路應用公司	—	180	27	153
NVIDIA Corp	—	18,536	960	17,576
恩智浦半導體股份有限公司	—	187	6	181
安森美半導體	—	321	9	312
Palo Alto Networks Inc	—	253	20	233
參數科技公司	—	87	—	87
科沃公司	—	79	7	72
高通公司	—	841	42	799
Roper科技公司	—	78	1	77
希捷科技控股公開有限公司	—	141	—	141
思佳訊半導體有限公司	—	118	—	118
超微電腦公司	—	39	4	35
新思科技公司	—	115	7	108
泰瑞達公司	—	108	—	108
德州儀器公司	—	693	42	651
天寶公司	—	205	14	191
維聖公司	—	68	8	60
威騰電子公司	—	243	8	235
斑馬科技公司	—	36	—	36

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
物料				
New Linde Plc	—	364	22	342
Steel Dynamics	—	112	7	105
房地產				
科斯塔集團公司	—	297	—	297
公用事業				
Alliant Energy Corp	—	194	11	183
美國電力公司	—	409	33	376
Constellation Energy Corp	—	249	21	228
Evergy公司	—	174	—	174
愛克斯龍公司	—	717	—	717
Xcel Energy Inc	—	417	20	397
紐約交易所上市股票				
通訊服務				
AT&T公司	—	5,362	239	5,123
Live Nation Entertainment Inc	—	101	—	101
奧姆尼康集團	—	147	9	138
埃培智集團	—	275	—	275
威瑞森電信公司	—	3,167	159	3,008
華特迪士尼公司	—	1,394	91	1,303
非必需消費				
安波福公開有限公司	—	210	10	200
汽車地帶公司	—	13	1	12
Bath & Body Works Inc	—	181	10	171
Best Buy	—	143	12	131
博格華納	—	224	41	183
CarMax Inc	—	111	—	111
嘉年華集團	—	738	34	704
奇波雷墨西哥燒烤公司	—	982	1	981
DR Horton Inc	—	238	24	214
達登餐廳	—	96	11	85
德克斯戶外用品公司	—	22	3	19
達美樂披薩股份有限公司	—	28	2	26
福特汽車公司	—	3,086	230	2,856
國際航電股份有限公司	—	120	5	115
通用汽車公司	—	903	73	830
純正零件公司	—	100	4	96

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
希爾頓全球控股公司	—	181	4	177
Home Depot Inc	—	758	50	708
拉斯維加斯金沙集團	—	270	—	270
萊納房屋公司	—	178	5	173
羅威	—	429	20	409
麥當勞公司	—	543	29	514
美高梅度假村國際	—	228	64	164
Mohawk Industries Inc	—	39	—	39
耐克	—	900	41	859
挪威郵輪控股有限公司	—	330	39	291
NVR Inc	—	2	—	2
普得集團公司	—	152	—	152
雷夫羅倫公司	—	39	8	31
皇家加勒比國際游輪	—	187	14	173
Tapestry Inc	—	179	17	162
TJX Cos Inc	—	870	55	815
VF Corporation	—	80	80	—
百勝餐飲	—	216	14	202
必需消費				
高特利集團	—	1,357	128	1,229
Archer-Daniels-Midland Co	—	394	40	354
百富門公司	—	129	—	129
邦吉有限公司	—	102	7	95
金寶湯公司	—	142	—	142
丘奇及德懷特公司	—	180	11	169
高樂氏公司	—	88	—	88
可口可樂	—	2,949	179	2,770
高露潔-棕欖公司	—	629	36	593
康尼格拉食品公司	—	342	—	342
星座公司	—	121	6	115
一元雜貨	—	162	7	155
雅詩蘭黛	—	167	—	167
通用磨坊	—	437	34	403
霍梅爾食品	—	206	—	206
J. M. Smucker	—	78	—	78
Kellanova	—	183	—	183
Kenvue Inc	—	1,429	75	1,354
金百利克拉克	—	254	16	238
克羅格	—	514	48	466
藍威斯頓控股公司	—	112	8	104
麥科明克公司(馬里蘭州)	—	183	—	183
摩紳庫爾斯飲料公司	—	141	—	141
菲利浦莫里斯國際公司	—	1,178	67	1,111

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
Procter & Gamble	—	1,800	114	1,686
西斯柯公司	—	364	12	352
目標百貨公司	—	348	17	331
好時公司	—	125	18	107
泰森食品	—	200	—	200
沃爾瑪公司	—	3,268	213	3,055
能源				
Chevron Corp	—	1,318	93	1,225
康菲石油	—	895	66	829
科特拉能源公司	—	547	34	513
戴文能源	—	482	39	443
依歐格資源	—	443	32	411
EQT Corp	—	333	—	333
Exxon Mobil Corp	—	3,437	237	3,200
哈里伯頓公司	—	692	76	616
赫斯公司	—	197	—	197
金德摩根公司(德拉瓦州)	—	1,443	90	1,353
馬拉松石油公司	—	453	27	426
Marathon Petroleum Corporation	—	270	14	256
西方石油	—	474	—	474
ONEOK Inc	—	424	9	415
Phillips 66	—	316	8	308
Pioneer Natural Resources	—	134	134	—
施蘭卜吉	—	1,135	100	1,035
Targa Resources Corp	—	176	12	164
瓦勒羅能源	—	251	17	234
威廉斯公司	—	922	60	862
金融				
美國家庭人壽保險公司	—	381	11	370
全州保險	—	216	27	189
美國運通	—	431	28	403
美國國際集團	—	524	49	475
阿默普萊斯金融公司	—	72	2	70
怡安公開有限公司	—	167	12	155
Arthur J Gallagher & Co	—	161	6	155
安信龍公司	—	38	—	38
美國銀行	—	5,214	353	4,861
紐約梅隆銀行	—	545	16	529
Berkshire Hathaway Inc	—	1,381	89	1,292
貝萊德公司	—	109	8	101
黑石公司	—	544	28	516

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
Brown & Brown Inc	—	179	8	171
第一資本金融公司	—	276	6	270
嘉信理財	—	1,099	44	1,055
丘博有限公司	—	303	13	290
花旗集團	—	1,468	94	1,374
公民金融集團公司	—	378	45	333
Comerica	—	97	97	—
Corpay Inc	—	53	3	50
發現金融服務公司	—	175	—	175
Everest Re Group Ltd	—	33	2	31
FactSet Research Systems Inc	—	26	—	26
富達全國資訊服務	—	460	62	398
Fiserv Inc	—	458	39	419
富蘭克林資源公司	—	278	62	216
環匯公司	—	188	12	176
環球人壽公司	—	60	7	53
高盛集團	—	246	16	230
哈特福德金融服務集團	—	222	7	215
洲際交易所	—	443	28	415
景順有限公司	—	325	—	325
摩根大通	—	2,205	150	2,055
科凱國際集團	—	660	—	660
科爾伯格-克拉維斯-羅伯茨公司	—	476	—	476
洛斯公司	—	130	—	130
M&T Bank Corp	—	125	10	115
馬什麥克倫南	—	364	12	352
Mastercard Inc	—	631	43	588
大都會人壽	—	440	12	428
穆迪	—	124	10	114
摩根士丹利	—	955	61	894
明晟公司	—	58	2	56
PNC金融服務集團	—	294	13	281
Progressive Corp	—	448	33	415
保德信金融	—	281	23	258
Raymond James Financial Inc	—	137	9	128
區域金融公司	—	773	112	661
標準普爾全球公司	—	242	13	229
道富銀行	—	240	23	217
同步金融	—	304	14	290
旅行者保險公司	—	186	19	167
Truist Financial Corp	—	1,016	61	955
美國合眾銀行	—	1,158	55	1,103
Visa Inc	—	1,210	83	1,127
W R Berkley Corp	—	146	—	146
富國銀行	—	2,733	253	2,480

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
健康護理				
雅培	—	1,291	54	1,237
艾伯維公司	—	1,334	76	1,258
安捷倫科技公司	—	207	—	207
Baxter International Inc	—	381	21	360
必帝公司	—	208	4	204
伯瑞股份有限公司	—	15	—	15
波士頓科學公司	—	1,144	85	1,059
百時美施貴寶公司	—	1,478	39	1,439
嘉德諾健康集團	—	179	6	173
康泰倫特公司	—	127	—	127
Cencora Inc	—	117	—	117
聖丁公司	—	384	8	376
查爾斯河實驗室國際公司	—	44	4	40
CVS Health Corp	—	929	41	888
丹納赫集團	—	514	40	474
德維特公司	—	49	10	39
愛德華生命科學	—	466	32	434
Elevance Health Inc	—	173	8	165
Eli Lilly & Co	—	608	37	571
HCA Healthcare Inc	—	149	10	139
哈門那公司	—	91	7	84
IQVIA控股公司	—	138	5	133
Johnson & Johnson	—	1,820	104	1,716
徠博科控股公司	—	69	8	61
Laboratory Corporation of America Holdings	—	57	57	—
麥卡遜	—	103	9	94
美敦力公司	—	1,038	81	957
默克藥廠	—	1,943	128	1,815
Mettler-Toledo國際公司	—	15	—	15
莫利納醫療保健公司	—	43	3	40
輝瑞大藥廠股份有限公司	—	4,152	145	4,007
奎斯特診斷公司	—	90	6	84
瑞斯邁股份有限公司	—	106	4	102
Revvity Inc	—	101	7	94
Solventum Corp	—	137	25	112
STERIS公開有限公司	—	70	—	70
史賽克	—	267	23	244
Teleflex Inc	—	36	—	36
信諾公司	—	210	9	201
賽默飛世爾科技有限公司	—	298	25	273
UnitedHealth Group Inc	—	703	47	656
環球健康服務公司	—	45	4	41
沃特斯公司	—	42	2	40
West Pharmaceutical Services Inc	—	53	3	50
捷邁邦美控股公司	—	164	15	149
碩騰股份有限公司	—	328	6	322

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
工業				
3M	—	408	10	398
A.O.史密斯公司	—	92	—	92
安朗杰有限公司	—	67	—	67
得邁斯	—	173	4	169
波音	—	433	19	414
Broadridge Financial Solutions	—	88	—	88
Builders FirstSource Inc	—	93	—	93
開利全球公司	—	616	13	603
卡特彼勒公司	—	388	37	351
康明斯公司	—	102	3	99
Dayforce Inc	—	123	—	123
迪爾	—	199	12	187
達美航空	—	478	—	478
多佛公司	—	107	5	102
伊頓公開有限公司	—	305	17	288
艾默生電氣	—	421	11	410
易速傳真公司	—	90	—	90
Expeditors International of Washington	—	110	5	105
聯邦快遞	—	170	6	164
Fortive Corp	—	259	—	259
奇異維諾瓦公司	—	201	4	197
基內瑞克控股公司	—	49	—	49
通用動力公司	—	174	9	165
通用電氣公司	—	837	51	786
Howmet航太公司	—	292	10	282
安柏	—	41	—	41
Huntington Ingalls Industries	—	29	—	29
IDEX Corp	—	58	—	58
伊利諾工具公司	—	199	4	195
英格索蘭公司	—	302	6	296
Jacobs Solutions Inc	—	93	—	93
江森自控國際公司	—	503	11	492
L3 哈里斯科技公司	—	140	3	137
雷多斯控股公司	—	106	5	101
馬斯可	—	167	—	167
諾福克南方公司	—	168	3	165
諾斯洛普格拉曼	—	104	4	100
奧的斯電梯公司	—	303	7	296
派克漢尼汾公司	—	96	4	92
Paycom軟體公司	—	38	—	38
濱特爾公開有限公司	—	123	—	123
廣達服務公司	—	109	3	106

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
共和服務公司	—	152	3	149
Robert Half	—	86	86	—
洛克威爾自動化公司	—	84	—	84
羅林斯公司	—	208	—	208
雷神科技公司	—	1,008	52	956
實耐寶公司	—	41	—	41
西南航空	—	450	—	450
史丹利百得公司	—	114	—	114
德事隆公司	—	147	—	147
特靈科技公開有限公司	—	172	8	164
TransDigm Group Inc	—	44	4	40
優步科技公司	—	1,586	84	1,502
聯合太平洋公司	—	465	26	439
聯合包裹服務公司	—	557	31	526
聯合租賃公司	—	52	3	49
Veralto Corp	—	167	—	167
格雷杰公司	—	36	4	32
西屋空氣制動技術公司	—	134	5	129
Waste Management Inc	—	274	10	264
Xylem Inc	—	181	5	176
資訊科技				
埃森哲有限公司	—	471	22	449
安費諾	—	870	21	849
Arista網路公司	—	184	6	178
康寧公司	—	598	48	550
億磐系統公司	—	44	5	39
Fair Isaac Corp	—	20	2	18
高德納公司	—	58	2	56
GoDaddy Inc	—	96	—	96
慧與	—	977	48	929
惠普	—	699	76	623
國際商業機器公司	—	691	35	656
捷普公司	—	106	20	86
瞻博網路	—	226	—	226
是德科技公司	—	137	12	125
摩托羅拉系統公司	—	127	6	121
甲骨文公司	—	1,221	82	1,139
Salesforce Inc	—	734	40	694
ServiceNow Inc	—	158	12	146
TE Connectivity Ltd	—	225	6	219
得立達科技公司	—	33	—	33
Tyler Technologies Inc	—	29	—	29

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
物料				
Air Products and Chemicals Inc	—	172	13	159
雅保公司	—	81	—	81
安姆科公開有限公司	—	1,079	—	1,079
艾利丹尼森	—	65	7	58
包爾公司	—	239	14	225
塞拉尼斯公司	—	70	—	70
CF Industries Holdings Inc	—	132	—	132
科迪華公司	—	505	24	481
陶氏	—	504	—	504
新杜邦公司	—	315	27	288
伊士曼化學有限公司	—	88	—	88
藝康集團	—	191	9	182
FMC Corp	—	100	23	77
自由港麥克莫蘭銅金公司	—	1,026	—	1,026
International Flavors & Fragrance	—	205	16	189
國際紙業	—	280	16	264
利安德巴塞爾工業公司	—	185	—	185
Martin Marietta Materials Inc	—	50	5	45
美盛公司	—	232	27	205
紐蒙特公司	—	909	76	833
諾可公司	—	189	22	167
美國包裝公司	—	65	4	61
匹茲堡工業	—	184	15	169
宣偉	—	187	18	169
瓦爾坎材料公司	—	101	6	95
西岩公司	—	191	19	172
房地產				
BXP, Inc	—	128	24	104
世邦魏理仕集團公司	—	217	—	217
金克不動產公司	—	496	46	450
公共存儲公司	—	124	9	115
賽門物業集團	—	256	18	238
UDR Inc	—	289	56	233

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
公用事業				
愛伊斯公司	—	498	—	498
阿莫林公司	—	200	9	191
美國水處理公司	—	152	13	139
Atmos Energy Corp	—	107	—	107
CenterPoint能源	—	457	—	457
CMS Energy Corp	—	205	—	205
聯合愛迪生	—	247	—	247
道明尼能源公司	—	601	—	601
DTE Energy Co	—	162	13	149
Duke Energy Corp	—	559	7	552
愛迪生國際	—	279	—	279
安特吉公司	—	149	—	149
Eversource Energy	—	249	—	249
FirstEnergy Corp	—	366	—	366
NextEra Energy Inc	—	1,579	111	1,468
NiSource公司	—	313	—	313
NRG Energy Inc	—	190	33	157
太平洋電力瓦斯	—	1,673	146	1,527
皮那可資本公司	—	91	10	81
PPL Corp	—	589	61	528
大眾服務企業集團	—	408	52	356
Sempra	—	489	39	450
南方公司	—	815	34	781
維斯達能源公司	—	249	16	233
WEC Energy Group Inc	—	226	—	226

投資組合變動表 (未經審核) (續)

2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間

投資	恒生標普500指數ETF			
	單位數目 2024年3月25日 (開始運作日期)	增加	減少	單位數目 2024年6月30日
集體投資計劃				
納斯達克交易所上市股票				
房地產				
Equinix REIT	—	75	6	69
Host Hotels & Resorts REIT	—	585	41	544
Regency Centers REIT	—	119	10	109
SBA Communications REIT	—	85	5	80
紐約交易所上市股票				
房地產				
Alexandria REIT	—	131	13	118
American Tower REIT	—	347	10	337
AvalonBay Communities REIT	—	103	—	103
Camden Property Trust REIT	—	95	13	82
Crown Castle REIT	—	320	10	310
Digital Realty Trust REIT	—	252	16	236
Equity Residential REIT	—	283	27	256
Essex Property Trust REIT	—	51	3	48
Extra Space Storage REIT	—	151	—	151
Healthpeak Property REIT	—	618	80	538
Invitation Homes REIT	—	455	25	430
Iron Mountain REIT	—	246	29	217
Mid-America Apartment Communities REIT	—	95	12	83
Prologis REIT	—	684	29	655
Realty Income Corporation REIT	—	623	—	623
Ventas REIT	—	301	21	280
VICI Properties REIT	—	801	32	769
Welltower REIT	—	438	10	428
Weyerhaeuser REIT	—	572	28	544
期貨合約				
E－迷你標普500期貨－2024年6月	—	30	30	—
E－迷你標普500期貨－2024年9月	—	31	2	29

簡明資產負債表 (未經審核)

2024年6月30日

	恒生A股行業龍頭指數ETF		恒生嘉實滬深300指數ETF		恒生A股通低碳指數ETF		恒生標普500指數ETF
	30-06-2024 (未經審核) (人民幣)	31-12-2023 (經審核) (人民幣)	30-06-2024 (未經審核) (人民幣)	31-12-2023 (經審核) (人民幣)	30-06-2024 (未經審核) (人民幣)	31-12-2023* (經審核) (人民幣)	30-06-2024* (未經審核) (美元)
資產							
按公平價值列入收入或虧損的金融資產	130,544,505	144,397,186	48,722,900	47,874,168	110,367,495	102,908,506	32,734,606
應收股息分派款項	1,350	–	–	–	–	–	13,401
應收認購單位款項	–	–	–	–	–	–	285,146
其他應收款項	1	–	271,165	300,962	–	75,900	2,111
現金及現金等價物	592,412	417,758	18,926	128,985	–	–	801,392
保證金存款	–	–	–	–	–	–	38,315
資產總值	131,138,268	144,814,944	49,012,991	48,304,115	110,367,495	102,984,406	33,874,971
負債							
按公平價值列入收入或虧損的金融負債	–	–	–	–	7	454	5,209
銀行透支	–	–	1,934	–	396,642	534,235	3
應付購入投資款項	–	–	–	–	–	–	261,914
應付贖回單位款項	–	–	–	–	–	–	77,756
預提費用及其他應付款項	235,047	240,027	163,153	289,864	202,522	234,601	90,249
負債總值 (不包括屬於單位持有人之資產淨值)	235,047	240,027	165,087	289,864	599,171	769,290	435,131
屬於單位持有人之資產淨值	130,903,221	144,574,917	48,847,904	48,014,251	109,768,324	102,215,116	33,439,840
代表：							
金融負債 – 單位持有人之資產淨值	–	–	–	–	109,768,324	102,215,116	33,439,840
權益總值	130,903,221	144,574,917	48,847,904	48,014,251	–	–	–
已發行單位數目							
上市類別	2,835,876	3,340,051	2,700,000	2,700,000	5,100,000	4,800,000	14,174,200
非上市類別- A類 (人民幣) – 累積收益單位	–	–	–	–	61,168	498	–
非上市類別- A類 (港元對沖) – 累積收益單位	–	–	–	–	23,973	34,133	–
非上市類別- A類 (美元) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	497,380
非上市類別- A類 (港元) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	806,629
非上市類別- A類 (人民幣對沖) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	804,705
非上市類別- D類 (港元) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	2,714,787
非上市類別- Z類 (美元) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	971,000
每單位資產淨值							
上市類別	46.1597	43.2852	18.0918	17.7831	21.3817	21.2379	1.0991
非上市類別- A類 (人民幣) – 累積收益單位	–	–	–	–	8.60	8.53	–
非上市類別- A類 (港元對沖) – 累積收益單位	–	–	–	–	8.17	7.88	–
非上市類別- A類 (美元) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	10.45
非上市類別- A類 (港元) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	1.34
非上市類別- A類 (人民幣對沖) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	1.42
非上市類別- D類 (港元) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	0.14
非上市類別- Z類 (美元) – 累積收益單位	–	–	–	–	–	–	10.47

* 恒生A股通低碳指數ETF開始運作日期為2023年3月28日。

* 恒生標普500指數ETF開始運作日期為2024年3月25日。

簡明全面收入表 (未經審核)

截至2024年6月30日止半年

	恒生A股行業龍頭指數ETF		恒生嘉實滬深300指數ETF		恒生A股通低碳指數ETF		恒生標普500指數ETF
	截至2024年 6月30日止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2023年 6月30日止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2024年 6月30日止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2023年 6月30日止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2024年 6月30日止半年 (未經審核) (人民幣)	由2023年 3月28日 (開始運作日期) 至2023年 6月30日止期間 (未經審核) (人民幣)	由2024年 3月25日 (開始運作日期) 至2024年 6月30日止期間 (未經審核) (美元)
收入							
股息收入	1,771,739	2,215,623	—	—	1,256,693	1,423,129	90,603
利息收入	591	745	732	720	540	233	8,700
基金經理費用付償	—	—	195,498	267,704	360,857	115,461	—
其他收入	—	1,375	—	—	—	234,526	9
	1,772,330	2,217,743	196,230	268,424	1,618,090	1,773,349	99,312
費用							
核數師酬金	(27,861)	(24,345)	(19,348)	(72,256)	(43,656)	(6,547)	(1,315)
法律及專業費用	(1,011)	—	(382)	—	(871)	—	—
管理費	(362,967)	(385,920)	—	—	(108,167)	(59,150)	(21,651)
成立費用	—	—	—	—	—	(1,514,339)	(109,152)
登記處費	—	—	(6,962)	(6,943)	(7,160)	(3,748)	(482)
證券託管及銀行費用	(23,669)	(14,965)	(553)	(174)	(11,021)	(4,536)	(453)
雜項費用	(217,920)	(212,120)	(154,555)	(141,613)	(228,677)	(96,330)	(19,326)
投資交易費用	(36,377)	(61,496)	—	—	(28,780)	—	(3,244)
付予受託人之交易費	—	—	—	—	(900)	(63,070)	(3,302)
受託人費	(51,149)	(56,134)	(30,389)	(47,250)	(69,313)	(56,367)	(3,287)
估值費	—	—	(20,300)	(40,250)	—	—	—
	(720,954)	(754,980)	(232,489)	(308,486)	(498,545)	(1,804,087)	(162,212)
計算投資收益／(虧損) 前的 收入／(損失)	1,051,376	1,462,763	(36,259)	(40,062)	1,119,545	(30,738)	(62,900)
投資收益／(虧損)							
投資淨收益／(虧損)	6,950,735	3,501,466	874,421	(67,239)	(436,750)	(5,570,047)	2,118,964
匯兌淨虧損	(4,649)	(14,528)	(4,493)	(12,924)	(4,567)	(3,432)	(112)
證券費用	(133,217)	(163,426)	—	—	—	—	—
	6,812,869	3,323,512	869,928	(80,163)	(441,317)	(5,573,479)	2,118,852
計算融資成本前的 收入／(損失)	7,864,245	4,786,275	833,669	(120,225)	678,228	(5,604,217)	2,055,952
融資成本							
利息支出	—	(2)	(11)	(2)	(11,677)	(306)	(4)
稅前收入／(損失)	7,864,245	4,786,273	833,658	(120,227)	666,551	(5,604,523)	2,055,948
稅項	(177,180)	(208,663)	(5)	(3)	(126,738)	(142,775)	(26,210)
屬於單位持有人的收入／ (損失) 及期間總全面收入	7,687,065	4,577,610	833,653	(120,230)	539,813	(5,747,298)	2,029,738

簡明權益變動表／屬於單位持有人之資產淨值變動表 (未經審核)

截至2024年6月30日止半年

	恒生A股行業龍頭指數ETF		恒生嘉實滬深300指數ETF		恒生A股通低碳指數ETF		恒生標普500指數ETF
	截至2024年 6月30日 止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2023年 6月30日 止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2024年 6月30日 止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2023年 6月30日 止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2024年 6月30日 止半年 (未經審核) (人民幣)	由2023年 3月28日 (開始運作日期) 至2023年 6月30日止期間 (未經審核) (人民幣)	由2024年 3月25日 (開始運作日期) 至2024年 6月30日止期間 (未經審核) (美元)
期初餘額	144,574,917	129,665,901	48,014,251	53,400,851	102,215,116	-	-
屬於單位持有人的收入／(損失)及期間總全面收入	7,687,065	4,577,610	833,653	(120,230)	539,813	(5,747,298)	2,029,738
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	14,516,710	38,064,214	-	-	50,073,767	128,105,857	34,328,586
贖回單位所付及應付款項	(35,875,471)	(19,607,929)	-	-	(43,060,372)	-	(2,918,484)
予單位持有人的收益分派	-	(254,487)	-	-	-	-	-
與所有者(即單位持有人)的交易總額	(21,358,761)	18,201,798	-	-	7,013,395	128,105,857	31,410,102
期末餘額	130,903,221	152,445,309	48,847,904	53,280,621	109,768,324	122,358,559	33,439,840

簡明權益變動表／屬於單位持有人之資產淨值變動表 (未經審核) (續)

截至2024年6月30日止半年

	恒生A股行業龍頭指數ETF		恒生嘉實滬深300指數ETF		恒生A股通低碳指數ETF		恒生標普500指數ETF
	截至2024年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	截至2023年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	截至2024年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	截至2023年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	截至2024年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	由2023年 3月28日 (開始運作日期) 至2023年 6月30日止期間 (未經審核) (單位數目)	由2024年 3月25日 (開始運作日期) 至2024年 6月30日止期間 (未經審核) (單位數目)
基金之已發行單位變動如下：							
上市類別：							
期初單位結餘	3,340,051	2,820,666	2,700,000	2,700,000	4,800,000	—	—
期間內發行單位數目	313,325	787,226	—	—	1,800,000	5,100,000	14,174,200
期間內贖回單位數目	(817,500)	(403,991)	—	—	(1,500,000)	—	—
期終單位結餘	2,835,876	3,203,901	2,700,000	2,700,000	5,100,000	5,100,000	14,174,200
非上市類別：							
A類(人民幣)－累積收益單位							
期初單位結餘	—	—	—	—	498	—	—
期間內發行單位數目	—	—	—	—	1,169,382	498	—
期間內贖回單位數目	—	—	—	—	(1,108,712)	—	—
期終單位結餘	—	—	—	—	61,168	498	—
A類(港元對沖)－累積收益單位							
期初單位結餘	—	—	—	—	34,133	—	—
期間內發行單位數目	—	—	—	—	22,978	34,133	—
期間內贖回單位數目	—	—	—	—	(33,138)	—	—
期終單位結餘	—	—	—	—	23,973	34,133	—

簡明權益變動表／屬於單位持有人之資產淨值變動表 (未經審核) (續)

截至2024年6月30日止半年

	恒生A股行業龍頭指數ETF		恒生嘉實滬深300指數ETF		恒生A股通低碳指數ETF		恒生標普500指數ETF
	截至2024年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	截至2023年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	截至2024年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	截至2023年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	截至2024年 6月30日 止半年 (未經審核) (單位數目)	2023年3月28日 (開始運作日期) 至2023年 6月30日期間 (未經審核) (單位數目)	2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年 6月30日期間 (未經審核) (單位數目)
A類(美元) – 累積收益單位							
期初單位結餘	-	-	-	-	-	-	-
期間內發行單位數目	-	-	-	-	-	-	600,682
期間內贖回單位數目	-	-	-	-	-	-	(103,302)
期終單位結餘	-	-	-	-	-	-	497,380
A類(港元) – 累積收益單位							
期初單位結餘	-	-	-	-	-	-	-
期間內發行單位數目	-	-	-	-	-	-	1,656,981
期間內贖回單位數目	-	-	-	-	-	-	(850,352)
期終單位結餘	-	-	-	-	-	-	806,629
A類(人民幣對沖) – 累積收益單位							
期初單位結餘	-	-	-	-	-	-	-
期間內發行單位數目	-	-	-	-	-	-	1,002,204
期間內贖回單位數目	-	-	-	-	-	-	(197,499)
期終單位結餘	-	-	-	-	-	-	804,705
D類(港元) – 累積收益單位							
期初單位結餘	-	-	-	-	-	-	-
期間內發行單位數目	-	-	-	-	-	-	3,697,306
期間內贖回單位數目	-	-	-	-	-	-	(982,519)
期終單位結餘	-	-	-	-	-	-	2,714,787
Z類(美元) – 累積收益單位							
期初單位結餘	-	-	-	-	-	-	-
期間內發行單位數目	-	-	-	-	-	-	1,000,000
期間內贖回單位數目	-	-	-	-	-	-	(29,000)
期終單位結餘	-	-	-	-	-	-	971,000

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

	除息日期	分派日期	每單位收益分派 (人民幣)	收益分派總額 (人民幣)
恒生A股行業龍頭指數ETF				
2024年中期收益分派	-	-	-	-
2023年中期收益分派	29-06-2023	28-07-2023	0.08	254,487

指數及上市基金之表現 (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

以人民幣計算之表現		
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A股行業龍頭指數ETF*	6.64%	3.69%
恒生A股行業龍頭指數#	7.27%	4.36%

資料來源：資產淨值由滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司提供。上市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。

以人民幣計算之表現		
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
恒生嘉實滬深300指數ETF*	1.78%	-0.20%
滬深300指數#	1.94%	0.33%

資料來源：資產淨值由滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司提供。上市基金之表現資料由基金經理提供。指數資料由彭博資訊提供。

以人民幣計算之表現		
基金／指數	由2024年1月1日至 2024年6月30日期間	由2023年3月28日 （開始運作日期）至 2023年6月30日期間
恒生A股通低碳指數ETF*	0.54%	-3.21%
恒生A股通低碳精選指數#	0.69%	-3.14%

資料來源：資產淨值由滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司提供。上市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。

以美元計算之表現	
基金／指數	由2024年3月25日 （開始運作日期） 至2024年6月30日期間
恒生標普500指數ETF *	不適用
恒生標普500指數#	不適用

資料來源：資產淨值由滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司提供。上市基金之表現資料由基金經理提供。指數資料由彭博資訊提供。

- * 表現以報價貨幣之資產淨值對資產淨值，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。

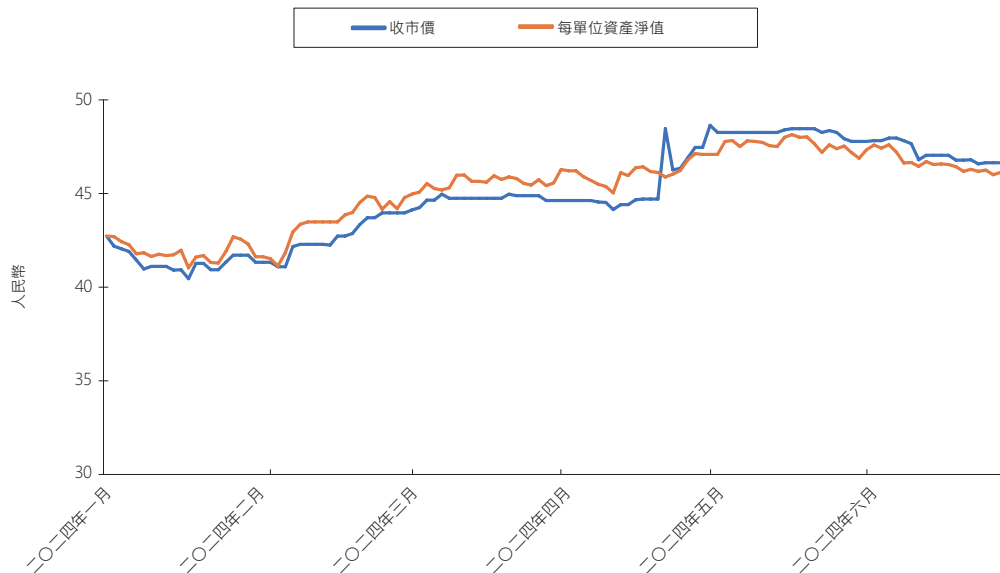
投資者須注意，所有投資均涉及風險（包括可能會損失投資本金），基金單位價格可升亦可跌，過往表現並不可作為日後表現的指引。投資者在作出任何投資決定前，應詳細閱讀有關基金之銷售文件（包括當中所載之風險因素之全文）。

上市基金每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核)

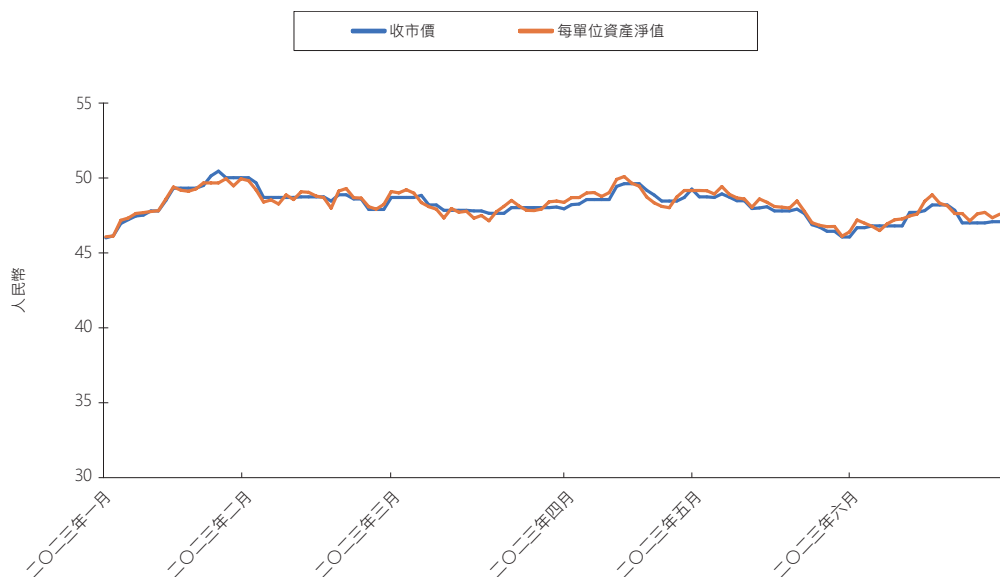
由2024年1月1日至2024年6月30日期間與2023年同期之比較

恒生A股行業龍頭指數ETF

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

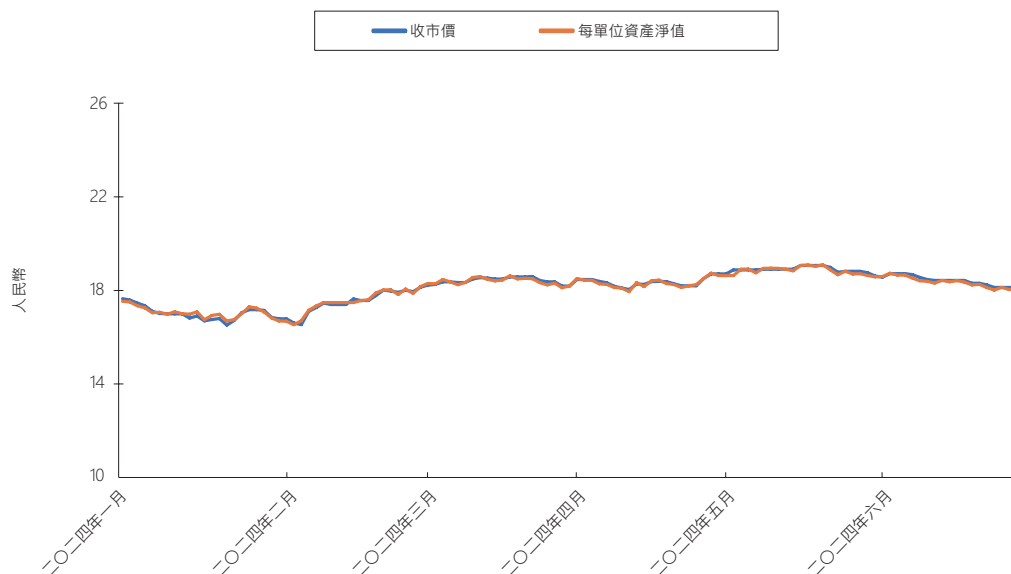


上市基金每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核) (續)

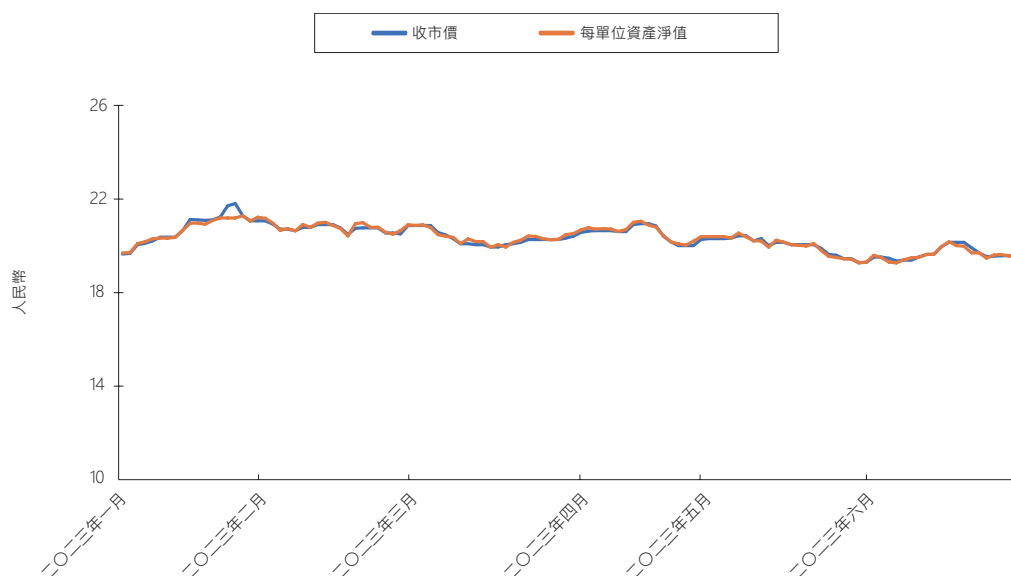
由2024年1月1日至2024年6月30日期間與2023年同期之比較

恒生嘉實滬深300指數ETF

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



上市基金每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核) (續)

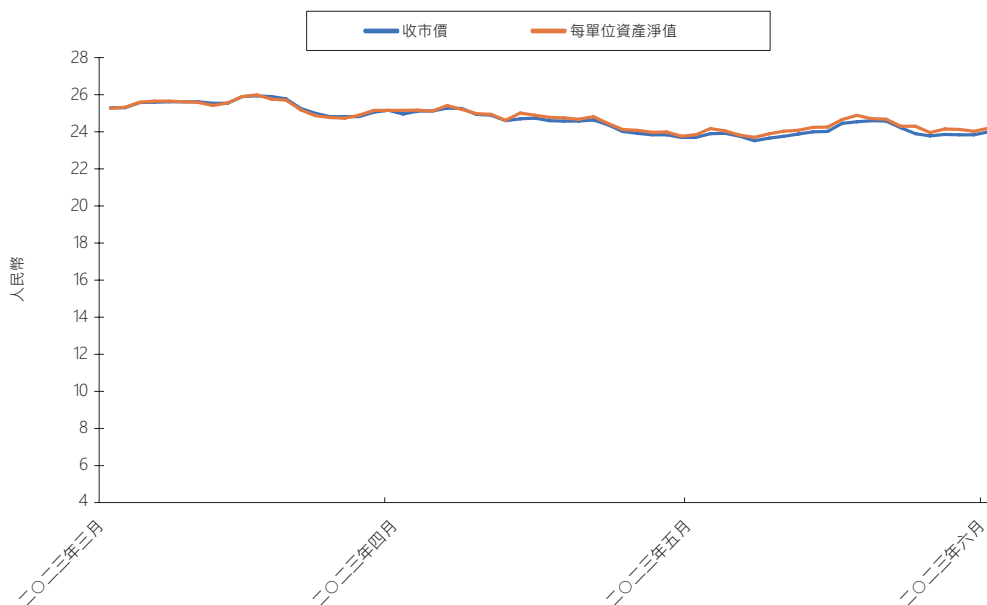
由2024年1月1日至2024年6月30日期間與由2023年3月30日 (上市日期) 至2023年6月30日期間之比較

恒生A股通低碳指數ETF

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



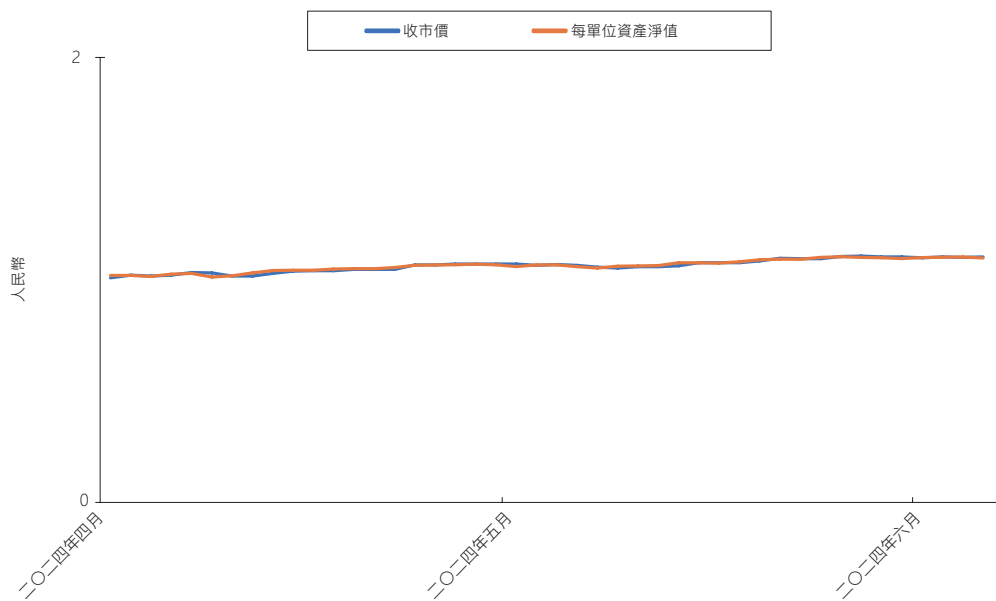
由2023年3月30日 (上市日期) 至2023年6月30日之每日收市價及每單位資產淨值之比較



上市基金每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核) (續)

由2024年4月23日 (上市日期) 至2024年6月30日期間

恒生標普500指數ETF
由2024年4月23日 (上市日期) 至2024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

下列為佔指數比重多於百分之十的成份股。

2024年6月30日

基金	指數	成份股	佔指數比重（百分比）
恒生A股行業龍頭指數ETF	於2024年6月28日，恒生A股行業龍頭指數沒有佔指數比重多於百分之十的成份股。		
恒生嘉實滬深300指數ETF	於2024年6月28日，滬深300指數沒有佔指數比重多於百分之十的成份股。		
恒生A股通低碳指數ETF	於2024年6月28日，恒生A股通低碳指數沒有佔指數比重多於百分之十的成份股。		
恒生標普500指數ETF	不適用		

2023年6月30日

基金	指數	成份股	佔指數比重（百分比）
恒生A股行業龍頭指數ETF	恒生A股行業龍頭指數	貴州茅臺	10.04%
恒生嘉實滬深300指數ETF	於2023年6月30日，滬深300指數沒有佔指數比重多於百分之十的成份股。		
恒生A股通低碳指數ETF	於2023年6月30日，恒生A股通低碳指數沒有佔指數比重多於百分之十的成份股。		

上市基金就投資限制之報告 (未經審核)

2024年6月30日

基於恒生A股行業龍頭指數ETF (「基金」) 的投資目標及恒生A股行業龍頭指數 (「指數」) 的性質：

- i) 如有關成份證券佔指數比重10%以上及基金所持任何該等成份證券並未超過彼等各自於指數內的比重 (除非該比重因指數組成變動而超過，且僅為過渡性及暫時性，或證監會另行批准者除外)，基金根據單位信託及互惠基金守則 (「守則」) 第8.6(h) 章獲准持有超過其最新可得資產淨值10%的任何單一發行人的證券投資。
- ii) 在守則第8.6(g)及(h)章之規限下，基金亦可將最新可得資產淨值的30%以上投資於同一項發行的政府及其他公共證券，亦可悉數投資於發行任何數量的政府及其他公共證券。

於2024年1月1日至2024年6月30日期間內，基金經理已就恒生A股行業龍頭指數ETF完全遵守以上限制。

恒生嘉實滬深300指數ETF是一隻聯接基金，尋求透過大致上 (至少90%的資產淨值) 投資於嘉實滬深300ETF (「主ETF」)，從而達致其投資目標。基金經理已向證監會申請，且證監會已授予恒生嘉實滬深300指數ETF以下豁免：

- (a) 《守則》第7.12(a)章下有關主ETF須獲證監會認可的規定；及
- (b) 《守則》第7.12(b)(ii)章下有關為遵守投資限制，子基金及主ETF須被視為單一實體的規定。

豁免的目的是令恒生嘉實滬深300指數ETF能夠作為聯接基金投資主ETF (未獲證監會認可)。

如ETF章程所述，當使用代表性抽樣策略時，特定成份證券在恒生A股通低低指數ETF及恒生標普500指數ETF (「子基金」) 中的權重可能會超過恒生A股通低低指數及標普500指數中的權重，而超配任何成份證券的最高限制為不超過子基金資產淨值的4%。

於2024年1月1日至2024年6月30日期間，基金經理在投資恒生A股通低低指數ETF時採用全面複製策略，因此以上限制並不適用。

於2024年3月25日 (開始運作日期) 至2024年6月30日期間，基金經理在投資標普500指數時採用全面複製策略，因此以上限制並不適用。

請參閱章程以悉投資限制詳情。

管理及行政

基金經理、上市代理人及RQFII持有人（僅就恒生A股行業龍頭指數ETF及恒生嘉實滬深300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 (已於2024年5月27日獲委任)

WHITE Stuart Kingsley (已於2024年5月27日辭任)

受託人及登記處

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

香港託管人（僅就恒生A股行業龍頭指數ETF、恒生A股通低碳指數ETF及恒生標普500指數ETF而言）

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

中國託管人（僅就恒生A股行業龍頭指數ETF及恒生嘉實滬深300指數ETF而言）

中國建設銀行

中國北京

西城區

金融大街25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

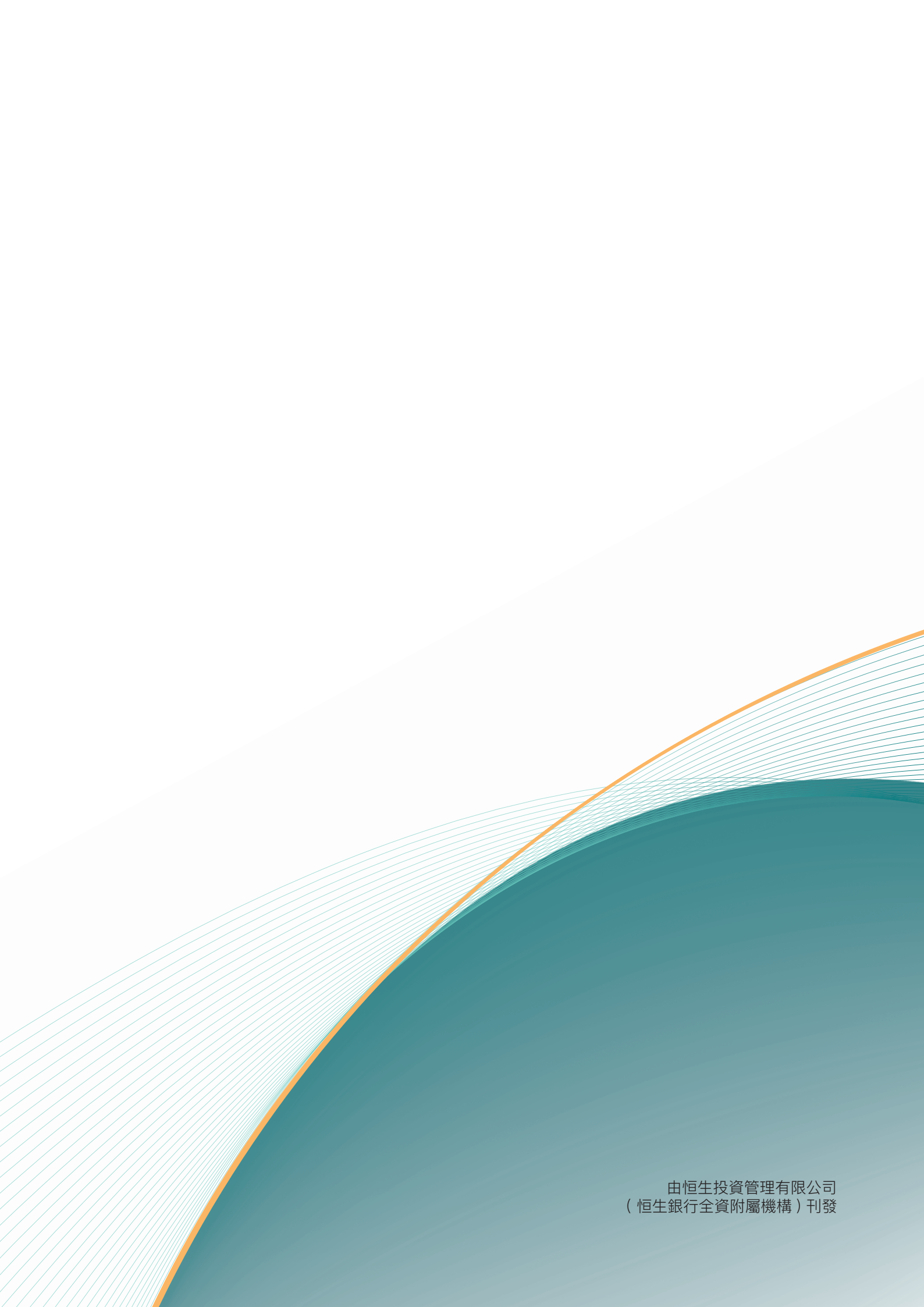
香港證券兌換代理服務有限公司

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