



恒生投資

HANG SENG INVESTMENT

# 恒生指数基金

中期财务报告

# 2018

# 目录

---

- 2 投资组合
- 4 投资组合变动表
- 5 资产负债表
- 6 恒生指数及恒生股指数基金的表现
- 7 恒生指数成份股披露
- 8 基金管理与行政管理

# 投资组合

2018年6月30日

投资	单位数目	市值 (港元)	占基金份额持有人的 资产净值的百分比
<b>按公允价值列入收入或亏损的金融资产</b>			
<b>香港交易所上市股票</b>			
<b>工商</b>			
瑞声科技	196,500	21,713,250	0.85%
中国蒙牛	737,000	19,604,200	0.77%
招商局港口控股	352,000	5,610,880	0.22%
中国移动	1,647,500	114,830,750	4.49%
中国石油化工	6,842,400	47,965,224	1.87%
中国神华能源	911,500	16,972,130	0.66%
中国联通	2,051,586	20,105,543	0.79%
中国中信	1,560,000	17,253,600	0.67%
长江和记实业	723,976	60,234,803	2.35%
中国海洋石油	4,790,000	64,856,600	2.53%
石药集团	1,256,000	29,767,200	1.16%
银河娱乐	636,000	38,637,000	1.51%
吉利汽车	1,444,000	29,385,400	1.15%
恒安国际	194,000	14,647,000	0.57%
港铁公司	402,995	17,489,983	0.68%
中国石油天然气	5,658,000	33,778,260	1.32%
金沙中国	649,600	27,250,720	1.07%
舜宇光学科技	191,200	27,915,200	1.09%
太古"A"	133,500	11,093,850	0.43%
腾讯控股	646,800	254,709,840	9.95%
中国旺旺	1,671,000	11,663,580	0.46%
万洲国际	2,361,500	15,089,985	0.59%
		900,574,998	35.18%
<b>金融</b>			
友邦保险控股	3,238,400	222,154,240	8.68%
中国银行	21,305,900	82,879,951	3.24%
交通银行	2,347,525	14,108,625	0.55%
东亚银行	370,940	11,628,969	0.45%
中银香港	992,500	36,672,875	1.43%
中国建设银行	25,791,660	186,989,535	7.30%
中国人寿保险	1,996,000	40,419,000	1.58%
恒生银行	205,100	40,240,620	1.57%
香港交易及结算所	315,928	74,559,008	2.91%
汇丰控股	3,425,526	252,118,714	9.85%
中国工商银行	19,785,610	116,141,531	4.54%
中国平安保险	1,398,000	100,935,600	3.94%
		1,178,848,668	46.04%
<b>地产</b>			
中国海外发展	1,028,720	26,592,412	1.04%
华润置地	743,111	19,655,286	0.77%
长江实业集团	693,976	43,234,705	1.69%
碧桂园	2,041,000	28,165,800	1.10%
恒隆地产	543,000	8,785,740	0.34%
恒基兆业地产	354,321	14,704,321	0.57%
新世界发展	1,624,615	17,935,750	0.70%
信和置业	777,400	9,919,624	0.39%
新鸿基地产	350,001	41,440,118	1.62%
九龙仓置业地产投资	326,162	18,216,148	0.71%
		228,649,904	8.93%
<b>公用事业</b>			
华润电力	515,200	7,120,064	0.28%
长江基建集团	177,500	10,321,625	0.40%
中电控股	508,000	42,926,000	1.68%
香港中华煤气	2,476,361	37,194,942	1.45%
电能实业	372,000	20,404,200	0.80%
		117,966,831	4.61%
<b>所有股票</b>		2,426,040,401	94.76%

## 投资组合 (续)

2018年6月30日

投资	单位数目	市值 (港元)	占基金份额持有人的 资产净值的百分比
<b>香港上市房地产投资信托基金</b>			
领展房产基金	576,500	41,306,225	1.61%
<b>期货合同</b>			
恒生指数期货合同 - 2018年7月份	49	58,650	0.00%
<b>按公允价值列入收入或亏损的金融资产总值</b>		<u>2,467,405,276</u>	<u>96.37%</u>
<b>按公允价值列入收入或亏损的金融负债</b>			
<b>远期合同</b>			
外汇远期合同		<u>(126,041)</u>	<u>0.00%</u>
<b>按公允价值列入收入或亏损的金融负债总值</b>		<u>(126,041)</u>	<u>0.00%</u>
<b>总投资市值</b>		2,467,279,235	96.37%
(总投资成本 - 2,047,210,009 港元)			
<b>其他资产净值</b>		<u>92,968,124</u>	<u>3.63%</u>
<b>基金份额持有人的资产净值</b>		<u><u>2,560,247,361</u></u>	<u><u>100.00%</u></u>

## 投资组合变动表

2018年6月30日

	基金份额持有人的总资产净值百分比	
	2018年6月30日	2017年12月31日
股票	94.76	97.27
房地产投资信托基金	1.61	1.67
远期合同	-	0.01
期货合同	-	0.02
总投资市值	<u>96.37</u>	<u>98.97</u>
其他资产净值	3.63	1.03
<b>基金份额持有人的总资产净值</b>	<b><u><u>100.00</u></u></b>	<b><u><u>100.00</u></u></b>

# 资产负债表

2018年6月30日

	2018年6月30日 (港元)	2017年12月31日 (港元)
<b>资产</b>		
按公允价值列入收入或亏损的金融资产	2,467,405,276	2,523,145,223
应收收益分配款项	12,829,258	-
应收认购基金份额款项	22,774,737	27,503,466
其他应收款项	659	301
保证金	9,059,054	3,314,473
现金及现金等价物	54,860,179	44,196,051
<b>资产总值</b>	<b>2,566,929,163</b>	<b>2,598,159,514</b>
<b>负债</b>		
按公允价值列入收入或亏损的金融负债	126,041	839
应付投资款项	-	30,622,126
应付赎回基金份额款项	3,213,062	14,901,892
预提费用及其他应付款项	3,342,699	3,108,085
<b>负债总值(不包括基金份额持有人的资产净值)</b>	<b>6,681,802</b>	<b>48,632,942</b>
<b>基金份额持有人的资产净值</b>	<b>2,560,247,361</b>	<b>2,549,526,572</b>
代表:		
<b>金融负债-基金份额持有人的资产净值</b>	<b>2,560,247,361</b>	<b>2,549,526,572</b>
<b>已发行基金份额总数目</b>		
派息基金份额 - A类基金份额	74,127,497	72,121,720
累积收益基金份额 - A类澳元(对冲)基金份额	189,650	69,975
累积收益基金份额 - A类人民币(对冲)基金份额	299,611	303,311
<b>每基金份额资产净值</b>		
派息基金份额 - A类基金份额	34.38	35.19
累积收益基金份额 - A类澳元(对冲)基金份额	82.62	88.76
累积收益基金份额 - A类人民币(对冲)基金份额	18.94	19.43

基金管理人欲强调公布的基金份额价格乃根据基金之基金说明书中所列明之原则计算。此计算原则与计算财务报告中《属于基金份额持有人之资产净值》及相关的《每基金份额资产净值》需按照的《香港财务报告准则》并不相同。因此，于本财务报告中所载之《属于基金份额持有人之资产净值》则有别于用作估值用途经调整后之资产净值。

## 恒生指数及恒生指数基金的表现

基金/指数	以港元计算的表现	
	由2018年1月1日至 2018年6月30日期间	由2017年1月1日至 2017年6月30日期间
恒生指数基金 - 派息基金份额 - A类基金份额*	-2.30%	18.66%
恒生指数#	-1.68%	19.42%

\*以基础货币（份额价对份额价），（任何存在的）股息再投资的总回报计算业绩。本基金现时只备有派息基金份额。现时基金管理人拟每年宣布派息。

#以股息再投资的总回报计算业绩，总回报为扣除预扣税后的净值。

数据源：汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司及恒生指数有限公司。

投资者须注意，所有投资均涉及风险(包括可能会损失投资本金)，基金基金份额价格可涨可跌，过往表现并不可作为日后业绩的指引。投资者在作出任何投资决定前，应详细阅读有关基金的销售文件(包括其中记录的风险因素的全文)。

## 恒生指数成份股披露

---

下列为占恒生指数（"该指数"）百分比多于十的成份股。

**2018年6月30日**

<b>成份股</b>	<b>占该指数比重(百分比)</b>
腾讯控股	10.32%
汇丰控股	10.22%

**2017年6月30日**

<b>成份股</b>	<b>占该指数比重(百分比)</b>
汇丰控股	10.67%
腾讯控股	10.30%

## 基金管理与行政管理

---

### 基金管理人

恒生投资管理有限公司  
香港中环德辅道中83号

### 受托人及登记处

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司  
香港中环皇后大道中1号

### 审计师

毕马威会计师事务所  
香港中环遮打道10号太子大厦8楼

### 基金管理人法律顾问

的近律师行  
香港中环遮打道18号历山大厦5楼

