



恒生投資

HANG SENG INVESTMENT

# 恒生中国企业指数基金

中期财务报告

# 2022

## 目录

---

- 2 投资组合
- 4 投资组合变动表
- 5 简明资产负债表
- 6 简明全面收益表
- 7 简明基金份额持有人的资产净值变动表
- 8 恒生中国企业指数及恒生中国企业指数基金的表现
- 9 恒生中国企业指数成份股披露
- 10 基金管理与行政管理

## 投资组合

2022年6月30日

投资	注册 / 成立地点	基金份额数目	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>交易所购买售出基金</b>				
恒生中国企业指数上市基金*	香港	5,021,243	390,351,431	98.45%
<b>远期合同</b>				
外汇远期合同				
货币/购买金额	货币/售出金额	结算日期	交易对手	
493,596人民币	577,300港元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	895 0.00%
801,644港元	147,278澳元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	6,816 0.00%
136,462港元	116,280人民币	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	252 0.00%
			7,963	0.00%
			<b>390,359,394</b>	<b>98.45%</b>
<b>按公允价值列入收入或亏损的金融资产总值</b>				
<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				
货币/购买金额	货币/售出金额	结算日期	交易对手	
35,661澳元	194,363港元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(1,911) (0.00%)
5,079,035澳元	27,671,080港元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(260,580) (0.07%)
985人民币	1,156港元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(2) (0.00%)
476,057人民币	558,639港元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(989) (0.00%)
37,129人民币	43,570港元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(77) (0.00%)
4,999,283人民币	5,866,403港元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(10,284) (0.00%)
64,205,298人民币	75,341,642港元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(132,070) (0.03%)
299,684人民币	351,781港元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(734) (0.00%)
509,533港元	94,645澳元	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(1,244) (0.00%)
114,822港元	98,131人民币	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(128) (0.00%)
1,439,188港元	1,229,979人民币	15/07/2022	香港上海汇丰银行有限公司	(1,600) (0.00%)
			(409,619)	(0.10%)
			<b>(409,619)</b>	<b>(0.10%)</b>
<b>按公允价值列入收入或亏损的金融负债总值</b>				
<b>总投资市值</b>			<b>389,949,775</b>	<b>98.35%</b>
<i>(总投资成本 - 529,955,947港元)</i>				
<b>其他资产净值</b>			<b>6,549,704</b>	<b>1.65%</b>
<b>基金份额持有人的资产净值</b>			<b>396,499,479</b>	<b>100.00%</b>

\* 该基金由恒生投资管理有限公司管理。

## 投资组合 (续)

2022年6月30日

恒生企业指数上市基金于2022年6月30日的投资组合如下:

香港上市投资	份额数目	市值(港元)	占基金份额持有人的资产净值的百分比	香港上市投资	份额数目	市值(港元)	占基金份额持有人的资产净值的百分比
<b>香港交易所上市股票</b>							
<b>综合企业</b>				<b>资讯科技</b>			
中国中信	22,963,245	182,557,798	0.74%	阿里巴巴集团	19,193,504	2,147,753,098	8.71%
				百度	1,477,446	219,400,731	0.89%
<b>非必需性消费</b>				京东集团	4,557,521	1,152,141,309	4.67%
安踏体育用品	3,414,383	329,146,521	1.34%	快手科技	6,725,182	587,780,907	2.38%
比亚迪	2,773,721	870,948,394	3.53%	联想集团	22,812,765	167,217,567	0.68%
吉利汽车	18,984,692	338,686,905	1.37%	美团	9,529,274	1,850,585,011	7.50%
海底捞国际控股	4,399,756	80,515,535	0.33%	网易	1,941,027	279,701,991	1.13%
李宁	7,436,723	540,649,762	2.19%	中芯国际	14,132,906	256,936,231	1.04%
申洲国际集团	2,610,471	248,125,269	1.01%	腾讯控股	5,158,640	1,828,222,016	7.41%
		2,408,072,386	9.77%	小米集团	55,211,227	753,081,136	3.05%
<b>必需性消费</b>						9,242,819,997	37.46%
中国飞鹤	15,464,608	139,490,764	0.57%	<b>地产建筑</b>			
中国蒙牛	9,985,833	390,945,362	1.59%	中国海外发展	12,094,911	299,953,793	1.22%
华润啤酒	5,122,362	299,658,177	1.22%	华润置地	10,130,287	370,768,504	1.50%
农夫山泉	6,358,668	286,457,993	1.16%	碧桂园	25,581,464	124,325,915	0.50%
		1,116,552,296	4.54%	碧桂园服务控股	6,374,030	222,772,348	0.90%
<b>能源</b>				龙湖集团	5,754,779	213,214,562	0.86%
中国石油化工	76,529,046	270,147,532	1.10%	融创中国	9,440,469	21,618,674	0.09%
中国海洋石油	56,388,532	584,185,192	2.37%			1,252,653,796	5.07%
		854,332,724	3.47%	<b>电讯</b>			
<b>金融</b>				中国移动	19,380,633	949,651,017	3.85%
中国农业银行	97,056,660	287,287,714	1.17%	<b>公用事业</b>			
中国银行	250,831,647	785,103,055	3.18%	中国燃气	9,613,473	116,515,293	0.47%
交通银行	27,637,054	149,792,833	0.61%	新奥能源	2,497,914	321,981,115	1.31%
中国建设银行	331,524,596	1,747,134,621	7.08%			438,496,408	1.78%
中国人寿保险	23,495,342	320,946,372	1.30%	<b>期货合约</b>			
招商银行	12,321,014	646,853,235	2.62%	恒生企业指数期货合同 -			
中国太平洋保险	8,324,786	159,669,395	0.65%	2022年7月份	65	636,300	0.00%
中国工商银行	232,940,369	1,085,502,120	4.40%	<b>按公允价值列入收入或亏损的金融资产总值</b>			
中国平安保险	19,988,180	1,066,369,403	4.32%			24,325,444,212	98.63%
中国邮政储蓄银行	34,482,232	214,824,305	0.87%	<b>期货合约</b>			
		6,463,483,053	26.20%	恒生企业指数期货合同 -			
<b>医疗保健</b>				2022年7月份	848	(4,600,850)	(0.02%)
阿里健康信息技术	14,938,076	80,665,610	0.33%	<b>按公允价值列入收入或亏损的金融负债总值</b>			
石药集团	28,259,970	220,145,166	0.89%			(4,600,850)	(0.02%)
信达生物制药	4,166,688	145,417,411	0.59%	<b>总投资市值</b>			
京东健康	3,530,460	217,299,813	0.88%	(总投资成本 - 23,506,898,577 港元)		24,320,843,362	98.61%
中国生物制药	35,674,601	177,302,767	0.72%	<b>其他资产净值</b>			
		840,830,767	3.41%			343,030,050	1.39%
<b>工业</b>				<b>基金份额持有人的资产净值</b>			
京东物流	5,857,531	100,280,931	0.41%			24,663,873,412	100.00%
舜宇光学科技	2,251,058	287,910,318	1.17%				
信义光能控股	15,442,774	187,166,421	0.76%				
		575,357,670	2.34%				

本基金只投资于恒生企业指数上市基金(“该基金”)。现时基金管理人豁免本基金的管理费用,至于该基金的管理费用为按资产净值计每年0.55%。可付予本基金受托人的受托人费用及该基金受托人的受托人费用的总和则为按资产净值计每年0.0925%。

## 投资组合变动表

2022年6月30日

	基金份额持有人的资产净值百分比	
	2022年6月30日	2021年12月31日
股票基金	98.45	99.87
远期合同	(0.10)	0.01
总投资市值	98.35	99.88
其他资产净值	1.65	0.12
<b>基金份额持有人持有人的资产净值</b>	<b>100.00</b>	<b>100.00</b>

## 简明资产负债表

2022年6月30日

	2022年6月30日 (未经审核)(港元)	2021年12月31日 (已经审核)(港元)
<b>资产</b>		
按公允价值列入收入或亏损的金融资产	390,359,394	369,864,061
应收收益分配款项	5,752,225	-
应收认购基金份额款项	3,663,907	273,662
应收投资款项	577,483	1,346,708
其他应收款项	355	230
现金及现金等价物	2,477,883	94,659
<b>资产总值</b>	<b>402,831,247</b>	<b>371,579,320</b>
<b>负债</b>		
按公允价值列入收入或亏损的金融负债	409,619	13,524
银行透支	-	660,377
应付投资款项	5,578,392	110,640
应付赎回基金份额款项	54,760	201,559
预提费用及其他应付款项	288,997	277,645
<b>负债总值(不包括基金份额持有人的资产净值)</b>	<b>6,331,768</b>	<b>1,263,745</b>
<b>基金份额持有人的资产净值</b>	<b>396,499,479</b>	<b>370,315,575</b>
代表:		
<b>金融负债-基金份额持有人的资产净值</b>	<b>396,499,479</b>	<b>370,315,575</b>
<b>已发行基金份额总数目</b>		
累积收益基金份额 - A1类基金份额	4,736,400	4,092,907
派息基金份额 - A类基金份额	287,497	287,497
累积收益基金份额 - A类基金份额	7,035,705	6,356,815
累积收益基金份额 - D类港元基金份额	6,311,521	5,425,035
累积收益基金份额 - A类澳元(对冲)基金份额	563,757	174,380
累积收益基金份额 - A类人民币(对冲)基金份额	494,858	425,047
累积收益基金份额 - M类人民币(对冲)基金份额	51,853,879	50,654,030
<b>每基金份额资产净值</b>		
累积收益基金份额 - A1类基金份额	8.27	8.74
派息基金份额 - A类基金份额	26.11	27.60
累积收益基金份额 - A类基金份额	33.69	35.62
累积收益基金份额 - D类港元基金份额	0.8521	0.9009
累积收益基金份额 - A类澳元(对冲)基金份额	46.72	52.38
累积收益基金份额 - A类人民币(对冲)基金份额	12.42	13.62
累积收益基金份额 - M类人民币(对冲)基金份额	1.4450	1.5862

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的资产净值》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的资产净值》则有别于用作估值用途经调整后之资产净值。

## 简明全面收益表

截至2022年6月30日止半年

	截至 2022年6月30日 止半年 (未经审核)(港元)	截至 2021年6月30日 止半年 (未经审核)(港元)
<b>收入</b>		
收益分配收入	5,752,225	3,431,131
利息收入	152	2,430
	<u>5,752,377</u>	<u>3,433,561</u>
<b>费用</b>		
审计师酬金	(55,970)	(66,009)
法律及专业服务费用	(2,648)	(2,098)
基金登记机构费	(7,736)	(7,736)
托管及银行费用	(89,378)	(97,355)
杂项费用	(44,398)	(108,440)
投资交易费用	(8,178)	(57,037)
付予受托人的交易费	(92,898)	(122,967)
受托人费	(80,234)	(112,826)
估值费	(95,600)	(96,000)
	<u>(477,040)</u>	<u>(670,468)</u>
<b>计算投资(亏损)/收益前的收入</b>	<u>5,275,337</u>	<u>2,763,093</u>
<b>投资(亏损)/收益</b>		
投资净(亏损)/收益	(28,321,956)	7,854,424
汇兑净(亏损)	(3,900)	(3,822)
证券费用	(2,856)	(3,614)
	<u>(28,328,712)</u>	<u>7,846,988</u>
<b>计算融资成本前的(亏损)/收入</b>	<u>(23,053,375)</u>	<u>10,610,081</u>
<b>融资成本</b>		
利息支出	(321)	(3,462)
<b>税前(亏损)/收入</b>	<u>(23,053,696)</u>	<u>10,606,619</u>
<b>税项支出</b>	<u>-</u>	<u>-</u>
<b>基金份额持有人的(亏损)/收入及年度总全面(亏损)/收入</b>	<u>(23,053,696)</u>	<u>10,606,619</u>

## 简明基金份额持有人的资产净值变动表

截至2022年6月30日止半年

	截至 2022年6月30日 止半年 (未经审核) (港元)	截至 2021年6月30日 止半年 (未经审核) (港元)
期初余额	370,315,575	573,352,393
基金份额持有人的(亏损)/收益及年度总全面(亏损)/收入	(23,053,696)	10,606,619
<b>与基金份额持有人的交易</b>		
发行基金份额所得及应收款项	70,010,388	83,958,318
赎回基金份额所付及应付款项	(20,772,788)	(203,020,348)
<b>与基金份额持有人的交易总额</b>	<b>49,237,600</b>	<b>(119,062,030)</b>
期末余额	396,499,479	464,896,982

### 基金已发行基金份额之变动如下:

基金份额类别	截至2022年6月30日止半年			
	期初 基金份额结余	期间内 发行基金份额	期间内 赎回基金份额	期末 基金份额结余
累积收益基金份额 - A1 类基金份额	4,092,907	1,219,726	(576,233)	4,736,400
派息基金份额 - A 类基金份额	287,497	-	-	287,497
累积收益基金份额 - A 类基金份额	6,356,815	981,183	(302,293)	7,035,705
累积收益基金份额 - A 类澳元(对冲)基金份额	174,380	416,523	(27,146)	563,757
累积收益基金份额 - A 类人民币(对冲)基金份额	425,047	72,056	(2,245)	494,858
累积收益基金份额 - M 类人民币(对冲)基金份额	50,654,030	3,588,980	(2,389,131)	51,853,879
累积收益基金份额 - D 类港元基金份额	5,425,035	2,606,449	(1,719,963)	6,311,521

基金份额类别	截至2021年6月30日止半年			
	期初 基金份额结余	期间内 发行基金份额	期间内 赎回基金份额	期末 基金份额结余
累积收益基金份额 - A1 类基金份额	1,351,482	3,082,216	(934,384)	3,499,314
派息基金份额 - A 类基金份额	307,293	-	(13,399)	293,894
累积收益基金份额 - A 类基金份额	7,599,364	575,916	(1,759,863)	6,415,417
累积收益基金份额 - A 类澳元(对冲)基金份额	241,571	16,697	(110,330)	147,938
累积收益基金份额 - A 类人民币(对冲)基金份额	317,936	261,449	(269,925)	309,460
累积收益基金份额 - M 类人民币(对冲)基金份额	91,083,908	3,428,108	(43,249,023)	51,262,993
累积收益基金份额 - D 类港元基金份额	1,573,910	5,901,978	(2,803,084)	4,672,804



## 恒生中国企业指数及恒生中国企业指数基金的表现

基金 / 指数	以港元计算的表现	
	由2022年1月1日至 2022年6月30日期间	由2021年1月1日至 2021年6月30日期间
恒生中国企业指数基金 - 累积收益基金份额 - A类基金份额*	-5.42%	0.18%
恒生中国企业指数 <sup>#</sup>	-5.35%	0.56%

\*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。

<sup>#</sup>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，应仔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)。

## 恒生中国企业指数成份股披露

---

2022年6月30日

成份股	占该指数比重(百分比)
-----	-------------

---

于2022年6月30日，该指数没有占指数比重多于百分之十的成份股。

2021年6月30日

成份股	占该指数比重(百分比)
-----	-------------

---

于2021年6月30日，该指数没有占指数比重多于百分之十的成份股。

## 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

### 内地代理人

中国建设银行股份有限公司  
北京市西二环路金融大街25号

