

## 恒生投資指數基金系列

# 恒生中國企業指數上市基金

2024年07月

### 給予香港投資者的重要風險警告 / 基金資料

- 從 2018 年 3 月 5 日起，恒生 H 股指數上市基金更名為恒生中國企業指數上市基金。
- 恒生中國企業指數上市基金（簡稱「恒生中國企業 ETF」）是一隻指數追蹤基金，其旨在於扣除費用前盡實際可能緊貼恒生中國企業指數（簡稱「該指數」）之表現。恒生中國企業 ETF 主要投資於該指數之成份股。
- 由於恒生中國企業 ETF 於香港聯合交易所有限公司上市，所以跟常見的單位信託基金有所不同，而恒生中國企業 ETF 所附帶的風險與其他上市股票相類似，例如：流通性風險及可能會停止買賣的風險。每基金單位的市價可受二級市場中市場供求、流通性及買賣價差等因素影響，而顯著地高於或低於其每基金單位的資產淨值，每基金單位的市價亦將會於交易日內不斷波動。
- 恒生中國企業 ETF 須承受追蹤誤差風險、被動式投資的風險、投資於單一市場/該指數數隻成份股之集中風險及投資於中國內地（一個新興市場）所涉及之風險。
- 恒生中國企業 ETF 亦須承受雙幣台風險、人民幣貨幣及匯兌風險、依賴莊家之風險及依賴同一個集團的風險。
- 基金經理可酌情從資本中作出派息，基金經理亦可酌情從總收入中作出派息，而同時將恒生中國企業 ETF 的所有或部分費用及開支記入恒生中國企業 ETF 資本賬下 / 從恒生中國企業 ETF 資本中扣除。這將導致恒生中國企業 ETF 可用作派發股息的可分派收益增加，因此恒生中國企業 ETF 可實際從資本中作出派息。從資本中作出派息或實際從資本中作出派息相當於從投資者原本的投資中或從原本的投資應佔的任何資本收益中退回或提取部分金額。任何涉及從恒生中國企業 ETF 的資本中作出派息或實際從恒生中國企業 ETF 的資本中作出派息的分派均可能導致恒生中國企業 ETF 的每單位資產淨值即時減少。
- 投資涉及風險：投資者可能會損失重大部分其於恒生中國企業 ETF 之投資。
- 投資者不應只單獨基於本資料而作出投資決定，而應細閱恒生中國企業 ETF 之銷售文件(包括當中所載之風險因素之全文)。

### 投資目標

恒生中國企業 ETF 為一指數追蹤基金，致力為投資者提供盡實際可能緊貼該指數表現的投資回報。

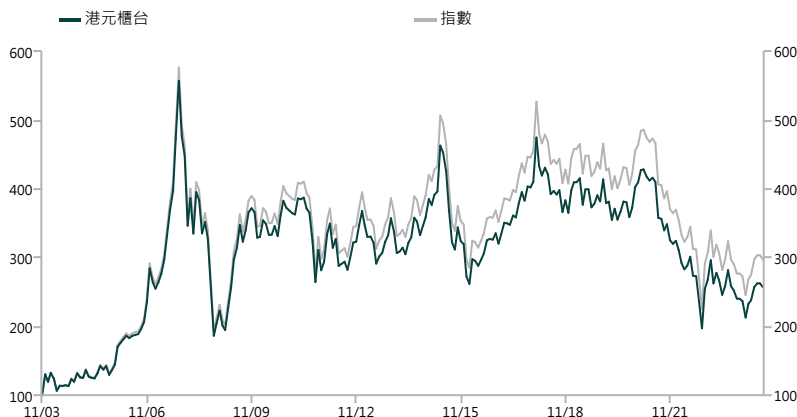
### 累積表現

	三個月	六個月	一年	三年	五年	成立至今
港元櫃台	-0.08%	20.62%	-8.81%	-28.14%	-35.63%	170.01%
指數	0.08%	20.99%	-8.20%	-26.84%	-33.64%	212.03%

### 年度表現

	年初至今	2023	2022	2021	2020	2019
港元櫃台	8.54%	-11.56%	-16.34%	-21.81%	-1.04%	13.30%
指數	8.94%	-10.99%	-15.87%	-21.41%	-0.33%	14.13%

### 基金表現



恒生中國企業 ETF：表現以資產淨值對資產淨值，股息(如有)再投資之總回報計算。(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。恒生中國企業 ETF 之表現資料由基金經理提供。)請注意，恒生中國企業 ETF 現時只備有派息單位。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。為使投資者可跟市場上的基金表現作出相互比較，2022 年 9 月 1 日起，基金經理更改投資組合和綜合回報的計算方法，變更為總回報是基於股息在除淨日而非派付日再投資計算。2022 年 9 月 1 日之前的表現不能夠跟新計算方法下的表現作出比較。

指數：恒生中國企業指數，表現以股息再投資之總回報計算，總回報為扣除內地預扣稅後之淨值。資料來源：恒生指數有限公司。上述數據顯示本基金價值在有關歷年內的升跌幅度。業績表現以港元計算，當中反映出基金的經常性開支，但並不包括閣下於聯交所交易的費用。

往績並非預測日後業績表現的指標。投資者未必能取回全部投資本金。

### 基金資料

上市交易所	香港聯合交易所- 主板
成立日	2003 年 11 月 19 日 <sup>^</sup>
上市日期	2003 年 12 月 10 日 <sup>^</sup>
追蹤指數	恒生中國企業指數
報價貨幣	港元
基金經理	恒生投資管理有限公司
受託人	滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司 <sup>*</sup>
以實物形式/現金新增或贖回	最少 100,000 個基金單位(或其倍數)及只可透過參與經紀商
每單位資產淨值	每單位 62.8145 港元
資產總值	206 億 5,382 萬港元
發行單位數量	328,806,822
所持股份數目	50
管理費	每年 0.55%
受託人費用	每年 0.0475%

<sup>^</sup> 此處顯示日期為港元櫃台上市日期及成立日。

<sup>\*</sup> 從 2019 年 5 月 1 日起，受託人由 HSBC Provident Fund Trustee (Hong Kong) Limited 更改為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司。

請參閱基金銷售文件「收費及支出」一節以悉投資涉及的所有費用及收費詳情。

### 主要投資

阿里巴巴 - SW	8.50%
美團 - W	8.09%
建設銀行	8.08%
騰訊控股	8.06%
中國移動	6.09%
工商銀行	4.63%
中國海洋石油	4.36%
小米集團 - W	4.01%
中國銀行	3.97%
比亞迪股份	3.25%



## 恒生中國企業指數上市基金

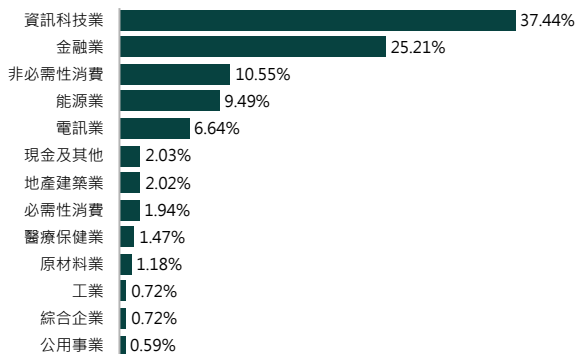
2024年07月

### 交易資訊

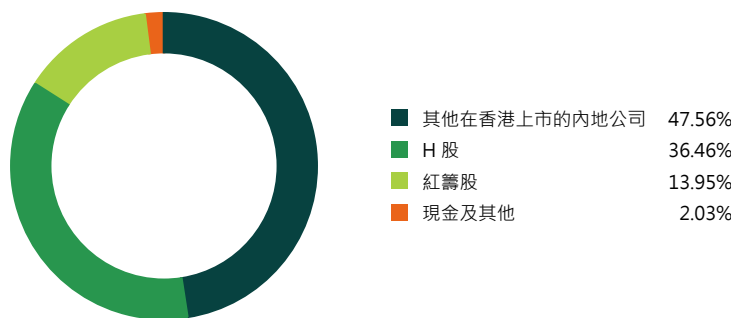
櫃台	每手交易單位	交易貨幣	國際證券號碼	彭博代碼	上市編號
港元櫃台	200	港元	HK2828013055	2828 HK	2828
人民幣櫃台	200	人民幣	HK0000251360	82828 HK	82828

此基金為互聯互通南向合資格 ETF (只限港元櫃台)。中國內地投資者請與相關經紀商查詢詳細資料。

### 行業分佈



### 股份類別分佈





## 恒生中國企業指數上市基金

2024年07月

### 參與經紀商名單+

ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited	J.P. Morgan Broking (Hong Kong) Limited
Barclays Bank PLC	韓國投資證券亞洲有限公司
BNP Paribas	Macquarie Markets Trading Limited
中銀國際證券有限公司	Merrill Lynch Far East Limited
招商證券(香港)有限公司	未來資產證券(香港)有限公司
花旗環球金融亞洲有限公司	Morgan Stanley Hong Kong Securities Limited
大和資本市場香港有限公司	農協投資證券(香港)有限公司
星展唯高達香港有限公司	野村國際(香港)有限公司
高盛(亞洲)證券有限公司	輝立證券(香港)有限公司
海通國際證券有限公司	法國興業證券(香港)有限公司
恒生證券有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
滙豐金融證券(香港)有限公司	UBS Securities Hong Kong Limited

\*最新之名單則請於 [www.hangsenginvestment.com](http://www.hangsenginvestment.com)\*查閱。

### 莊家名單+

#### 港元櫃台

Barclays Bank PLC
法國巴黎證券(亞洲)有限公司
Citadel Securities (Hong Kong) Limited
花旗環球金融亞洲有限公司
中信里昂證券有限公司
Eclipse Options (HK) Limited
Flow Traders Hong Kong Limited
滙豐證券經紀(亞洲)有限公司
IMC Asia Pacific Ltd.
盈透證券香港有限公司
Jane Street Asia Trading Limited
Jump Trading Hong Kong Limited
Jump Trading Pacific Pte. Ltd.
韓國投資證券亞洲有限公司
未來資產證券(香港)有限公司
Optiver Trading Hong Kong Ltd.
輝立證券(香港)有限公司
Phillip Securities Pte Ltd.
QCTA VCC
法國興業證券(香港)有限公司
Susquehanna Hong Kong Limited
滙澤證券有限公司
UTR8 AP Limited
Virtu Financial Singapore PTE. Ltd.
XTX Markets Pte. Ltd.
躍龍研發有限公司

\*最新之名單則請於 [www.hangsenginvestment.com](http://www.hangsenginvestment.com)\*查閱。

### 派息記錄

派息櫃台	派息頻率	記錄日	派息記錄
港元櫃台	每半年(如有)	2024年6月28日	0.65 港元
人民幣櫃台	每半年(如有)	2024年6月28日	0.65 港元

由2017年5月29日起，基金經理擬於每年6月及9月(更改前為每年6月及11月)宣佈派息。股息收益率為正數並不意味著正回報。

派息政策: 由基金經理酌情派發每半年現金股息(如有)(預期分別為就每個曆年的上半年以及每個曆年的下半年分派)。現時基金經理擬於每年6月及9月宣佈派息。不論持有人民幣買賣基金單位或港元買賣基金單位，每位單位持有人僅以港元收取派息，並不保證會定期派息及(如派息)所派發的金額。基金經理可酌情從資本中作出派息。基金經理亦可酌情從總收入中作出派息，而同時將恒生中國企業ETF的所有或部分費用及開支記入恒生中國企業ETF資本賬下/從恒生中國企業ETF資本中扣除，這將導致恒生中國企業ETF可用作派發股息的可分派收益增加，因此恒生中國企業ETF可實際從資本中作出派息。從資本中作出派息或實際從資本中作出派息相當於從投資者原本的投資中或從原本的投資應佔的任何資本收益中退回或提取部分金額。任何涉及從資本中作出派息或實際從資本中作出派息的分派均可導致每基金單位資產淨值即時減少。

就往年所有派息記錄，請於網站 [www.hangsenginvestment.com](http://www.hangsenginvestment.com)\*查閱。

### 波幅

	1年	3年
標準差	19.75	28.60
夏普比率	-0.61	-0.35

港元櫃台

資料來源: 晨星(亞洲)有限公司

### 基金文件



基金銷售文件可在此下載

### 獎項

- 《香港交易所大獎 - 證券獎項》2022 最佳表現交易所買賣產品 - 淨現金流量
- 《彭博商業周刊/中文版》領先基金大獎 2022 指數股票型基金(淨資產值一年追蹤誤差) - 中國股票 - 卓越大獎
- 《彭博商業周刊/中文版》領先基金大獎 2021 指數股票型基金(淨資產值一年追蹤誤差) - 中國股票 - 卓越大獎
- 《彭博商業周刊/中文版》領先基金大獎 2020 指數股票型基金(淨資產值一年追蹤誤差) - 中國股票 - 卓越大獎
- 2020《指標》年度基金大獎 最佳 ESG 表現大獎 - 同級最佳 - 中國股票 最佳全球契約表現大獎 - 同級最佳 - 中國股票 可持續發展進步獎 - ESG - 同級最佳 - 中國股票
- 《彭博商業周刊/中文版》領先基金大獎 2018 指數股票型基金(淨資產值一年回報) - 中國股票 - 卓越大獎

註:

- 《香港交易所大獎 - 證券獎項》2022 最佳表現交易所買賣產品 - 淨現金流量, 2022年1月3日至12月30日淨現金流量最高的在香港主要上市交易所買賣產品(交易所買賣基金及槓桿及反向產品)
- 《彭博商業周刊/中文版》領先基金大獎 2021-2022 之頒發機構為《彭博商業周刊/中文版》，反映截至該年度9月30日之一年表現。
- 《彭博商業周刊/中文版》領先基金大獎 2020-2021 之頒發機構為《彭博商業周刊/中文版》，反映截至該年度9月30日之一年表現。
- 《彭博商業周刊/中文版》領先基金大獎 2019-2020 之頒發機構為《彭博商業周刊/中文版》，反映截至該年度9月30日之一年表現。
- 2020《指標》年度基金大獎，反映截至該年度最少三年之表現。
- 《彭博商業周刊/中文版》領先基金大獎 2018-2019 之頒發機構為《彭博商業周刊/中文版》，反映截至該年度9月30日之一年表現。

(資料來源: 恒生投資管理有限公司/滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司/晨星(亞洲)有限公司。所有資料截至2024年7月31日。)

請閱讀恒生中國企業ETF之香港銷售文件內有關該指數的免費聲明。恒生中國企業ETF已獲香港證券及期貨事務監察委員會(「證監會」)認可。(證監會認可不等如對恒生中國企業ETF作出推介或認許，亦不是對恒生中國企業ETF的商業利弊或表現作出保證，更不代表恒生中國企業ETF適合所有投資者，或認許恒生中國企業ETF適合任何個別投資者或任何類別的投資者。)本資料單張內某些資料是取自恒生投資管理有限公司(「恒生投資」)合理地相信可靠的來源所編寫的，就由外界提供並如此披露的資料。恒生投資合理地相信該等資料是準確及完整的。本資料單張僅供參考之用，並不構成建議買賣恒生中國企業ETF基金單位的意見、招徠手法或推介。投資者須注意所有投資均涉及風險，而且並非所有投資風險都可以預計。基金單位價格可升亦可跌，而所呈列的過往表現資料並不表示將來亦有類似的表現。投資者在作出任何投資決定前，應詳細閱讀恒生中國企業ETF之香港銷售文件(包括當中所載之風險因素之全文(例如遇恒生中國企業ETF之基金單位被聯交所除牌之安排的資料))及在有需要時徵詢適當的專業意見。本資料單張並未經證監會審核。