



恒生投資

HANG SENG INVESTMENT

# 恒生指数基金

中期财务报告

# 2017

# 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

2017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	205,500	20,056,800	0.86%
百丽国际	1,878,000	11,568,480	0.49%
国泰航空	219,000	2,654,280	0.11%
中国蒙牛	765,000	11,704,500	0.50%
招商局国际	352,970	7,641,801	0.33%
中国移动	1,710,000	141,673,500	6.05%
中国石油化工	7,104,400	43,265,796	1.85%
中国神华能源	946,000	16,441,480	0.70%
中国联通	1,667,586	19,343,998	0.83%
中国中信	1,619,000	19,007,060	0.81%
长江和记实业	752,476	73,742,648	3.15%
中国海洋石油	4,972,000	42,510,600	1.81%
银河娱乐	655,000	31,047,000	1.33%
吉利汽车	1,492,000	25,125,280	1.07%
恒安国际	201,500	11,606,400	0.50%
昆仑能源	900,000	5,958,000	0.25%
联想集团	2,010,000	9,909,300	0.42%
港铁公司	411,495	18,085,205	0.77%
中国石油天然气	5,876,000	28,087,280	1.20%
金沙中国	674,400	24,109,800	1.03%
太古"A"	139,000	10,598,750	0.45%
腾讯控股	841,800	235,030,560	10.03%
中国旺旺	1,743,000	9,185,610	0.39%
		818,354,128	34.93%
<b>金融</b>			
友邦保险控股	3,357,000	191,516,850	8.17%
中国银行	22,113,900	84,696,237	3.62%
交通银行	2,436,525	13,425,253	0.57%
东亚银行	413,740	13,880,977	0.59%
中银香港	1,030,500	38,489,175	1.64%
中国建设银行	30,117,660	182,211,843	7.78%
中国人寿保险	2,071,000	49,393,350	2.11%
恒生银行	212,900	34,766,570	1.48%
香港交易及结算所	323,829	65,348,692	2.79%
汇丰控股	3,310,330	240,495,475	10.27%
中国工商银行	20,537,610	108,233,205	4.62%
中国平安保险	1,451,500	74,679,675	3.19%
		1,097,137,302	46.83%
<b>地产</b>			
长江实业地产	740,976	45,310,682	1.93%
中国海外发展	1,070,720	24,465,952	1.04%
华润置地	771,111	17,542,775	0.75%
恒隆地产	564,000	10,998,000	0.47%
恒基兆业地产	334,837	14,582,151	0.62%
新世界发展	1,617,615	16,030,565	0.68%
信和置业	783,400	10,027,520	0.43%
新鸿基地产	363,001	41,636,215	1.78%
九龙仓集团	339,162	21,943,781	0.94%
		202,537,641	8.64%
<b>公用事业</b>			
长江基建集团	184,000	12,070,400	0.52%
华润电力	535,200	8,199,264	0.35%
中电控股	528,000	43,612,800	1.86%
香港中华煤气	2,336,510	34,299,967	1.46%
电能实业	386,500	26,649,175	1.14%
		124,831,606	5.33%
<b>所有股票</b>		2,242,860,677	95.73%

## 投资组合 (续)

2017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>房地产投资信托基金</b>			
<b>地产</b>			
领展房产基金	616,500	36,620,100	1.56%
<b>远期合同</b>			
外汇远期合同		132,634	0.01%
<b>按公允价值列入收入或亏损的金融资产总值</b>		<u>2,279,613,411</u>	<u>97.30%</u>
<b>按公允价值列入收入或亏损的金融负债</b>			
<b>期货合同</b>			
恒生指数期货合同 - 2017年7月份		(156,099)	(0.01%)
<b>按公允价值列入收入或亏损的金融负债总值</b>		<u>(156,099)</u>	<u>(0.01%)</u>
<b>总投资市值</b>		<u>2,279,457,312</u>	<u>97.29%</u>
(总投资成本 - 1,970,364,100 港元)			
<b>其他资产净值</b>		<u>63,553,914</u>	<u>2.71%</u>
<b>基金份额持有人的资产净值</b>		<u><u>2,343,011,226</u></u>	<u><u>100.00%</u></u>

## 投资组合变动表

2017年6月30日

	基金份额持有人的总资产净值百分比	
	2017年6月30日	2016年12月31日
股票	95.73	97.48
房地产投资信托基金	1.56	1.55
远期合同	0.01	(0.01)
期货合同	(0.01)	0.01
总投资市值	<u>97.29</u>	<u>99.03</u>
其他资产净值	2.71	0.97
<b>基金份额持有人的总资产净值</b>	<b><u>100.00</u></b>	<b><u>100.00</u></b>

## 资产负债表

2017年6月30日

	2017年6月30日 (港元)	2016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	2,279,613,411	2,386,698,784
应收收益分配款项	20,795,267	-
应收认购基金份额款项	21,775,557	25,871,531
其他应收款项	511	-
保证金	3,183,348	2,044,305
现金及现金等价物	24,585,043	31,983,964
<b>资产总值</b>	<b>2,349,953,137</b>	<b>2,446,598,584</b>
<b>负债</b>		
按公允价值列入收入或亏损的金融负债	156,099	174,761
应付投资款项	-	31,987,696
应付赎回基金份额款项	3,629,893	1,019,663
预提费用及其他应付款项	3,155,919	3,615,621
<b>负债总值(不包括基金份额持有人的资产净值)</b>	<b>6,941,911</b>	<b>36,797,741</b>
<b>基金份额持有人的资产净值</b>	<b>2,343,011,226</b>	<b>2,409,800,843</b>
代表:		
<b>金融负债-基金份额持有人的资产净值</b>	<b>2,343,011,226</b>	<b>2,409,800,843</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	76,460,150	92,238,682
累积收益基金份额 - A类澳元(对冲)基金份额	79,354	547,844
累积收益基金份额 - A类人民币(对冲)基金份额	248,398	432,151
<b>每基金份额资产净值</b>		
派息基金份额 - A类基金份额	30.52	25.72
累积收益基金份额 - A类澳元(对冲)基金份额	74.12	58.12
累积收益基金份额 - A类人民币(对冲)基金份额	15.72	12.49

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2017年1月1日至 2017年6月30日期间	由2016年1月1日至 2016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*	18.66%	-3.08%
恒生指数#	19.42%	-2.57%

\*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。

#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。

**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%
------	--------

**2016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	10.17%
------	--------



## 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