



恒生投資
HANG SENG INVESTMENT

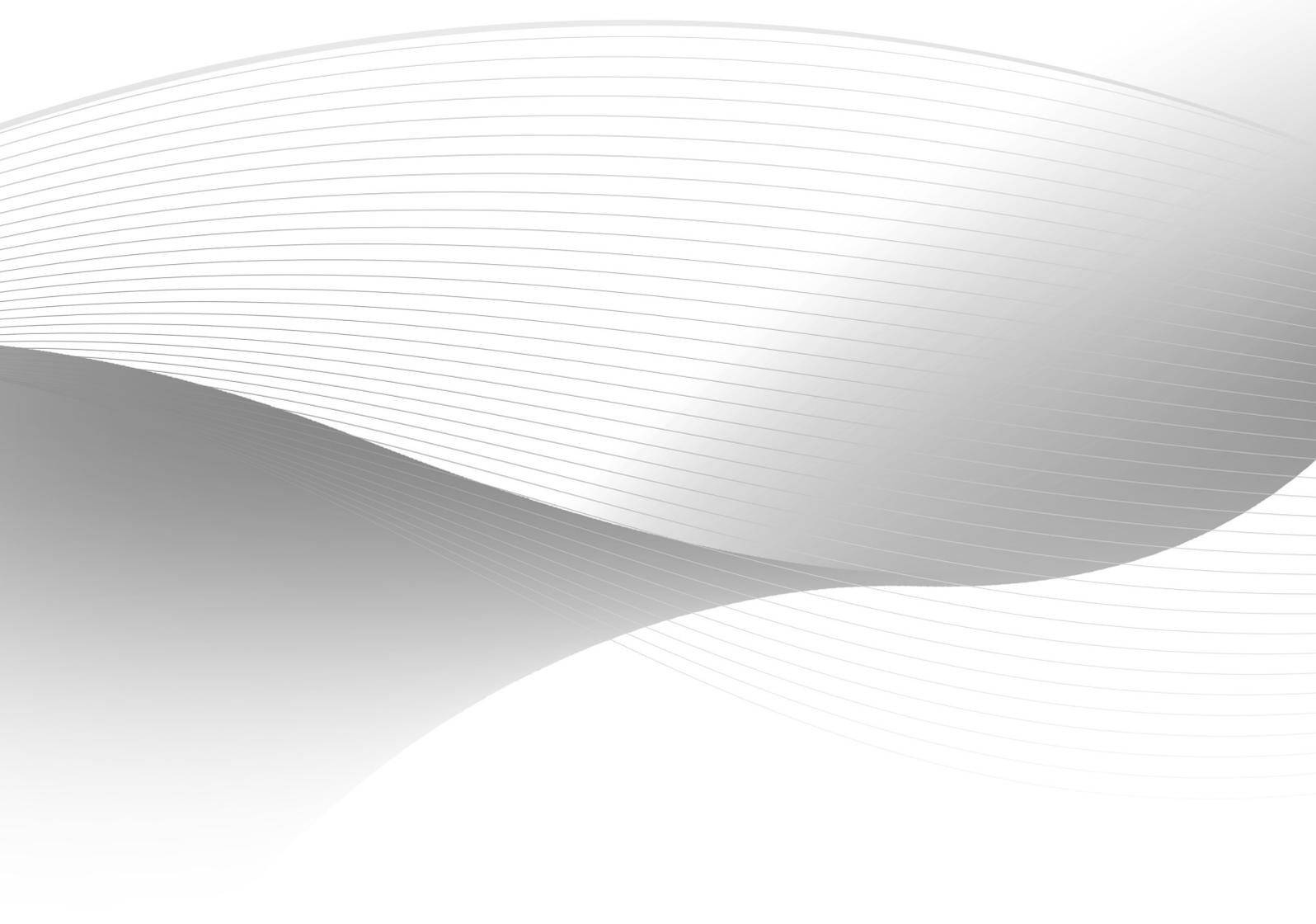
恒生 A 股行業龍頭指數 ETF
恒生嘉實滬深 300 指數 ETF
恒生 A 股通低碳指數 ETF

中期財務報告

2023

目錄

中期財務報告 2023	2
投資組合 (未經審核)	3
投資組合變動表 (未經審核)	16
簡明資產負債表 (未經審核)	27
簡明全面收入表 (未經審核)	28
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)	29
派息披露 (未經審核)	31
指數及上市基金之表現 (未經審核)	32
上市基金每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核)	33
指數成份股披露 (未經審核)	36
上市基金就投資限制之報告 (未經審核)	37
管理及行政	38



中期財務報告2023

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)

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)

2023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	81,400	1,911,272	1.25%
上海汽車	62,400	884,208	0.58%
		2,795,480	1.83%
必需性消費			
海天味業	41,900	1,963,015	1.29%
內蒙古伊利實業	130,800	3,704,256	2.43%
貴州茅臺酒	9,000	15,219,000	9.98%
		20,886,271	13.70%
能源			
中國石油化工	409,300	2,603,148	1.71%
中國神華能源	71,045	2,184,634	1.43%
中國石油天然氣	243,900	1,821,933	1.20%
陝西煤業	72,500	1,318,775	0.86%
兗礦能源	16,100	481,712	0.32%
		8,410,202	5.52%
金融			
中國農業銀行	686,897	2,424,746	1.59%
中國銀行	453,500	1,773,185	1.16%
中國建設銀行	143,400	897,684	0.59%
中國工商銀行	870,108	4,193,921	2.75%
中國平安保險	198,100	9,191,840	6.03%
		18,481,376	12.12%
醫療保健			
江蘇恒瑞醫藥	82,305	3,942,410	2.59%
上海復星醫藥	27,400	846,660	0.56%
藥明康德	41,356	2,576,892	1.69%
		7,365,962	4.84%
工業			
中遠海控	122,400	1,150,560	0.75%
隆基綠能科技	138,700	3,976,529	2.61%
		5,127,089	3.36%
資訊科技			
工業富聯	85,500	2,154,600	1.41%
中芯國際	40,009	2,021,255	1.33%
上海韋爾半導體	16,605	1,627,954	1.07%
		5,803,809	3.81%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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			
寶山鋼鐵	167,600	941,912	0.62%
恒力石化	45,100	646,283	0.42%
萬華化學	37,200	3,267,648	2.14%
紫金礦業	332,300	3,778,251	2.48%
		8,634,094	5.66%
地產建築			
安徽海螺水泥	47,300	1,122,902	0.74%
中國交通建設	50,500	550,955	0.36%
中國中鐵	198,900	1,507,662	0.99%
中國建築	405,960	2,330,210	1.53%
		5,511,729	3.62%
電訊			
中國移動	16,400	1,530,120	1.00%
中國衛通集團	8,700	172,956	0.11%
中國電信	334,000	1,880,420	1.23%
中國聯通	376,400	1,806,720	1.19%
		5,390,216	3.53%
公用事業			
中國核能電力	161,200	1,136,460	0.75%
三峽能源	307,900	1,653,423	1.08%
中國長江電力	203,740	4,494,504	2.95%
華能國電	93,949	869,968	0.57%
		8,154,355	5.35%
深圳證券交易所上市股票			
非必需性消費			
比亞迪	19,500	5,036,265	3.30%
珠海格力電器	96,900	3,537,819	2.32%
美的集團	105,800	6,233,736	4.09%
		14,807,820	9.71%
必需性消費			
宜賓五糧液	41,800	6,837,226	4.48%
益海嘉里	17,400	695,826	0.46%
		7,533,052	4.94%
醫療保健			
邁瑞醫療	13,000	3,897,400	2.56%
雲南白藥	15,480	812,390	0.53%
		4,709,790	3.09%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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	61,500	14,070,585	9.23%
立訊精密工業	99,700	3,235,265	2.12%
順豐控股	47,400	2,137,266	1.40%
		19,443,116	12.75%
資訊科技			
杭州海康威視數字技術	80,597	2,668,567	1.75%
中興通訊	68,500	3,119,490	2.05%
		5,788,057	3.80%
原材料			
榮盛石化	75,700	881,148	0.58%
地產建築			
萬科企業	136,041	1,907,295	1.25%
公用事業			
中國廣核電力	126,000	391,860	0.26%
總投資市值 (總投資成本 – 142,569,206人民幣)		152,022,721	99.72%
其他資產淨值		422,588	0.28%
屬於單位持有人之資產淨值		152,445,309	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300ETF	13,447,800	53,105,362	99.67%
總投資市值 (總投資成本 – 64,954,921人民幣)		53,105,362	99.67%
其他資產淨值		175,259	0.33%
屬於單位持有人之資產淨值		53,280,621	100.00%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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
上海證券交易所上市股票			
非必需性消費			
中國國航	17,900	147,496	0.12%
星宇股份	1,000	123,600	0.10%
中國東方航空	36,800	175,168	0.14%
中國南方航空	29,100	175,473	0.14%
中國中免	8,600	950,558	0.78%
科沃斯	1,600	124,432	0.10%
福耀玻璃	9,500	340,575	0.28%
長城汽車	8,200	206,394	0.17%
廣汽集團	14,600	152,132	0.12%
海爾智家	29,200	685,616	0.56%
華域汽車	9,600	177,216	0.15%
拓普集團	2,900	234,030	0.19%
歐派家居	1,200	114,960	0.09%
上汽集團	19,900	281,983	0.23%
上海機場	7,300	331,566	0.27%
錦江酒店	2,900	122,786	0.10%
晨光股份	2,900	129,456	0.11%
		4,473,441	3.65%
必需性消費			
重慶啤酒	1,500	138,240	0.11%
東鵬飲料	600	103,740	0.08%
海天味業	13,200	618,420	0.51%
內蒙古伊利實業	40,400	1,144,128	0.94%
今世緣	5,300	279,840	0.23%
貴州茅臺酒	4,000	6,764,000	5.53%
山西汾酒	3,300	610,731	0.50%
水井坊	1,400	82,586	0.07%
青島啤酒	2,100	217,623	0.18%
		9,959,308	8.15%
能源			
中海油田服務	3,800	52,744	0.04%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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
金融			
中國農業銀行	289,200	1,020,876	0.83%
北京銀行	128,300	594,029	0.49%
成都銀行	26,400	322,344	0.26%
中國銀行	161,700	632,247	0.52%
交通銀行	203,200	1,178,560	0.96%
杭州銀行	23,800	279,650	0.23%
江蘇銀行	97,900	719,565	0.59%
南京銀行	70,000	560,000	0.46%
上海銀行	76,800	441,600	0.36%
中信銀行	26,200	156,676	0.13%
中國建設銀行	52,500	328,650	0.27%
中國光大銀行	166,700	511,769	0.42%
中國銀河	10,800	125,388	0.10%
中金公司	6,400	227,328	0.19%
中國人壽保險	13,000	454,480	0.37%
招商銀行	92,300	3,023,748	2.47%
招商證券	28,700	389,459	0.32%
中國民生銀行	269,400	1,010,250	0.83%
中國太保	27,700	719,646	0.59%
浙商銀行	121,290	320,206	0.26%
中信証券	74,500	1,473,610	1.20%
中信建投證券	15,400	372,680	0.30%
光大證券	15,600	247,884	0.20%
國泰君安	33,500	468,665	0.38%
海通證券	73,100	673,982	0.55%
華泰證券	45,300	623,781	0.51%
華夏銀行	45,900	248,319	0.20%
中國工商銀行	326,900	1,575,658	1.29%
興業銀行	121,600	1,903,040	1.56%
興業證券	54,600	334,152	0.27%
新華保險	7,100	261,067	0.21%
東方證券	40,700	394,790	0.32%
中國人保	34,300	200,312	0.16%
中國平安保險	68,200	3,164,480	2.59%
中國郵政儲蓄銀行	103,900	508,071	0.42%
浦發銀行	144,000	1,042,560	0.85%
滬農商行	40,200	219,090	0.18%
浙商證券	15,500	153,140	0.13%
中泰證券	21,000	145,110	0.12%
		27,026,862	22.09%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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			
同仁堂	4,800	276,288	0.23%
萬泰生物	2,780	185,621	0.15%
華熙生物	1,459	130,084	0.11%
白雲山	4,800	153,024	0.13%
金城醫學	2,000	151,000	0.12%
江蘇恒瑞醫藥	25,900	1,240,610	1.01%
上海復星醫藥	8,300	256,470	0.21%
君實生物	2,573	99,163	0.08%
通策醫療	1,500	145,290	0.12%
藥明康德	12,700	791,337	0.65%
片仔癀	2,200	629,992	0.51%
		4,058,879	3.32%
工業			
航發動力	8,900	376,114	0.31%
中航沈飛	5,600	252,000	0.21%
中國船舶	16,100	529,851	0.43%
中國能建	84,800	198,432	0.16%
中遠海控	36,300	341,220	0.28%
中國中車	73,200	475,800	0.39%
大秦鐵路	36,500	271,195	0.22%
福萊特玻璃	3,900	150,189	0.12%
福斯特	5,900	219,421	0.18%
恒立液壓	3,100	199,423	0.16%
中天科技	20,600	327,746	0.27%
隆基綠能科技	41,900	1,201,273	0.98%
明陽智能	13,400	226,192	0.19%
國電南瑞	27,000	623,700	0.51%
德業股份	1,000	149,550	0.12%
寧波港	25,600	86,784	0.07%
容百科技	1,974	106,636	0.09%
杉杉股份	9,000	136,260	0.11%
三一重工	41,400	688,482	0.56%
上海電氣	32,900	150,353	0.12%
上港集團	23,400	122,850	0.10%
璞泰來	8,590	328,310	0.27%
生益科技	7,800	110,760	0.09%
特變電工	22,600	503,754	0.41%
通威股份	16,900	579,839	0.47%
天合光能	9,325	397,338	0.33%
上機數控	1,500	111,825	0.09%
圓通速遞	16,100	234,416	0.19%
正泰電器	7,800	215,670	0.18%
時代電氣	1,797	75,222	0.06%
		9,390,605	7.67%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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			
三六零	24,400	305,976	0.25%
思瑞浦	535	116,630	0.10%
中微公司	2,950	461,528	0.38%
金山辦公	1,444	681,886	0.56%
中國通號	15,783	91,541	0.07%
華潤微	3,064	160,584	0.13%
中科曙光	9,500	483,550	0.40%
工業富聯	30,700	773,640	0.63%
兆易創新	4,300	456,875	0.37%
立昂微	3,300	121,209	0.10%
士蘭微	6,000	181,620	0.15%
恒生電子	10,600	469,474	0.38%
長電科技	10,500	327,285	0.27%
瀾起科技	5,813	333,782	0.27%
中芯國際	11,934	602,906	0.49%
實信軟件	4,800	243,888	0.20%
傳音控股	2,530	371,910	0.30%
斯達半導	500	107,600	0.09%
上海韋爾半導體	6,900	676,476	0.55%
聞泰科技	6,300	308,070	0.25%
用友網絡	15,100	309,550	0.25%
		7,585,980	6.19%
原材料			
寶山鋼鐵	47,800	268,636	0.22%
中國巨石	15,700	222,312	0.18%
中國化學	24,100	199,548	0.16%
洛陽鉬業	48,100	256,373	0.21%
合盛砂業	1,900	133,038	0.11%
江西銅業	5,300	100,594	0.08%
寶豐能源	13,600	171,496	0.14%
山東黃金	10,500	246,540	0.20%
華魯恒升	9,600	294,048	0.24%
南山鋁業	38,900	117,478	0.10%
三棵樹	1,260	82,429	0.07%
桐昆股份	10,900	144,425	0.12%
萬華化學	10,900	957,456	0.78%
大全能源	3,315	134,092	0.11%
華友鈷業	8,100	371,871	0.30%
紫金礦業	100,800	1,146,096	0.94%
		4,846,432	3.96%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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			
安徽海螺水泥	13,000	308,620	0.25%
中國交通建設	15,900	173,469	0.14%
中國中鐵	61,000	462,380	0.38%
中國鐵建	30,700	302,395	0.25%
中國建築	124,700	715,778	0.59%
金地集團	33,600	242,256	0.20%
保利發展	68,300	889,949	0.73%
新城控股	5,800	83,578	0.07%
四川路橋	14,420	141,460	0.12%
		3,319,885	2.73%
電訊			
中國移動	5,100	475,830	0.39%
中國電信	100,100	563,563	0.46%
中國聯通	112,400	539,520	0.44%
		1,578,913	1.29%
公用事業			
中國核能電力	55,400	390,570	0.32%
三峽能源	92,000	494,040	0.40%
中國長江電力	60,700	1,339,042	1.10%
新奧股份	6,000	113,880	0.09%
華能水電	11,700	83,421	0.07%
川投能源	8,300	124,915	0.10%
		2,545,868	2.08%
深圳證券交易所上市股票			
非必需性消費			
比亞迪	6,000	1,549,620	1.27%
長安汽車	31,100	402,123	0.33%
一汽解放	6,300	52,731	0.04%
分眾傳媒	83,800	570,678	0.47%
珠海格力電器	33,800	1,234,038	1.01%
華利集團	1,100	53,614	0.04%
德賽西威	1,300	202,553	0.17%
芒果超媒	5,900	201,839	0.17%
TCL科技	95,900	377,846	0.31%
蘇泊爾	1,300	65,000	0.05%
		4,710,042	3.86%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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	900	222,642	0.18%
海大集團	5,500	257,620	0.21%
溫氏股份	36,700	673,445	0.55%
雙匯發展	6,800	166,532	0.14%
洋河股份	4,000	525,400	0.43%
酒鬼酒	1,700	153,255	0.13%
瀘州老窖	5,200	1,089,764	0.89%
牧原股份	21,500	906,225	0.74%
新希望	15,000	175,200	0.14%
宜賓五糧液	13,100	2,142,767	1.75%
金龍魚	5,300	211,947	0.17%
貝泰妮	900	79,992	0.07%
		6,604,789	5.40%
能源			
東方盛虹	15,100	178,482	0.15%
美錦能源	17,800	134,212	0.11%
		312,694	0.26%
金融			
寧波銀行	38,700	979,110	0.80%
東方財富	104,400	1,482,480	1.21%
廣發證券	22,800	335,388	0.27%
國信證券	28,100	245,313	0.20%
同花順	1,800	315,504	0.26%
平安銀行	74,700	838,881	0.69%
申萬宏源	79,200	365,904	0.30%
		4,562,580	3.73%
醫療保健			
愛爾眼科	33,151	614,951	0.50%
凱萊英	1,500	176,790	0.14%
長春高新	2,100	286,230	0.23%
智飛生物	9,150	404,430	0.33%
泰格醫藥	5,000	322,700	0.26%
華東醫藥	5,900	255,883	0.21%
華蘭生物	6,800	152,388	0.12%
愛美客	700	311,465	0.26%
康泰生物	4,000	101,560	0.08%
樂普醫療	8,300	187,663	0.15%
歐普康視	3,300	99,627	0.08%
康龍化成	3,900	149,292	0.12%
上海萊士	34,000	255,340	0.21%
邁瑞醫療	4,500	1,349,100	1.10%
沃森生物	10,800	285,660	0.23%
雲南白藥	5,200	272,896	0.22%
新和成	10,300	158,620	0.13%
		5,384,595	4.37%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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	4,600	111,734	0.09%
中航光電	7,150	324,253	0.27%
中航西飛	9,000	240,750	0.20%
京東方	216,800	886,712	0.72%
三環集團	8,200	240,670	0.20%
招商公路	13,000	124,800	0.10%
振華科技	2,500	239,625	0.20%
中偉股份	1,700	102,425	0.08%
寧德時代	19,000	4,347,010	3.55%
億緯鋰能	8,900	538,450	0.44%
錦浪科技	1,300	135,330	0.11%
歌爾股份	17,100	303,525	0.25%
國軒高科	7,100	196,102	0.16%
晶澳科技	11,840	493,728	0.40%
先導智能	7,000	253,190	0.21%
藍思科技	16,500	194,040	0.16%
領益智造	18,800	129,908	0.11%
立訊精密工業	31,500	1,022,175	0.84%
順豐控股	14,900	671,841	0.55%
深南電路	1,300	97,981	0.08%
德方納米	1,400	154,322	0.13%
匯川技術	12,600	809,046	0.66%
陽光電源	8,100	944,703	0.77%
欣旺達	9,200	150,144	0.12%
邁為股份	1,100	186,318	0.15%
視源股份	2,400	160,416	0.13%
TCL中環	19,750	655,700	0.54%
濰柴動力	35,400	441,084	0.36%
高德紅外	14,430	112,121	0.09%
徐工機械	43,300	293,141	0.24%
金風科技	18,000	191,160	0.16%
韻達股份	8,800	84,128	0.07%
三花智控	13,000	393,380	0.32%
中聯重科	43,400	292,950	0.24%
		15,522,862	12.70%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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			
三七互娛	13,700	477,856	0.39%
科大訊飛	14,900	1,012,604	0.83%
北京君正	1,900	167,789	0.14%
浪潮信息	7,900	383,150	0.31%
卓勝微	2,500	241,575	0.20%
北方華創	2,100	667,065	0.55%
納思達	5,700	195,225	0.16%
深信服	2,100	237,825	0.19%
聖邦股份	2,080	170,830	0.14%
中科創達	2,300	221,605	0.18%
紫光股份	11,300	359,905	0.29%
紫光國微	4,300	400,975	0.33%
億聯網絡	5,100	178,857	0.15%
世紀華通	40,000	303,600	0.25%
大華股份	13,900	274,525	0.22%
晶盛機電	4,900	347,410	0.28%
中興通訊	21,700	988,218	0.81%
		6,629,014	5.42%
原材料			
中信特鋼	6,200	98,208	0.08%
贛鋒鋳業	7,200	438,912	0.36%
天賜材料	8,200	337,758	0.28%
華峰化學	11,300	77,518	0.06%
龍佰集團	8,400	138,600	0.11%
聯泓新科	2,100	52,290	0.04%
鹽湖股份	24,500	469,665	0.38%
榮盛石化	21,200	246,768	0.20%
衛星化學	10,700	160,072	0.13%
天齊鋳業	7,200	503,352	0.41%
恩捷股份	3,800	366,130	0.30%
藏格礦業	6,800	153,476	0.13%
		3,042,749	2.48%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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			
北新建材	6,500	159,315	0.13%
招商蛇口	22,500	293,175	0.24%
萬科企業	50,900	713,618	0.58%
華僑城A	24,700	108,680	0.09%
天山股份	10,600	86,284	0.07%
		1,361,072	1.11%
公用事業			
中國廣核電力	40,400	125,644	0.10%
龍源電力	900	20,250	0.02%
		145,894	0.12%

投資組合 (未經審核) (續)

2023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
遠期合約			
外匯遠期合約			
買入	賣出	結算日期	交易對手
			The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
HKD327,343	CNH302,481	14/07/2023	
			701
			0.00%
按公平價值列入收入或虧損的金融資產總值			123,115,909
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
			The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
CNH1,701	HKD1,839	14/07/2023	
			(2)
			(0.00%)
HKD2,048	CNH1,902	14/07/2023	
			(5)
			(7)
			(0.00%)
按公平價值列入收入或虧損的金融負債總值			(7)
總投資市值			123,115,902
<i>(總投資成本 – 128,681,745人民幣)</i>			
其他負債淨值			(757,343)
屬於單位持有人之資產淨值			122,358,559
			100.00%

投資組合變動表 (未經審核)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股行業龍頭指數ETF			
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	單位數目 2023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	73,300	19,200	11,100	81,400
上海汽車	67,900	13,400	18,900	62,400
必需性消費				
海天味業	31,500	15,900	5,500	41,900
內蒙古伊利實業	111,500	39,900	20,600	130,800
貴州茅臺酒	7,900	2,500	1,400	9,000
能源				
中國石油化工	277,600	185,400	53,700	409,300
中國神華能源	63,945	16,600	9,500	71,045
中國石油天然氣	282,200	71,100	109,400	243,900
陝西煤業	65,700	16,600	9,800	72,500
兗礦能源	14,900	2,800	1,600	16,100
金融				
中國農業銀行	618,197	160,300	91,600	686,897
中國銀行	409,200	106,500	62,200	453,500
中國建設銀行	130,400	27,100	14,100	143,400
中國工商銀行	783,108	228,800	141,800	870,108
中國平安保險	178,300	52,500	32,700	198,100
醫療保健				
江蘇恒瑞醫藥	74,105	20,900	12,700	82,305
上海復星醫藥	20,600	8,500	1,700	27,400
藥明康德	37,256	11,000	6,900	41,356
工業				
中遠海控	111,000	27,200	15,800	122,400
隆基綠能科技	124,800	37,000	23,100	138,700
資訊科技				
工業富聯	76,900	20,100	11,500	85,500
中芯國際	36,061	9,294	5,346	40,009
上海韋爾半導體	13,905	5,000	2,300	16,605
原材料				
寶山鋼鐵	151,300	34,600	18,300	167,600
恒力石化	41,000	13,800	9,700	45,100
萬華化學	33,500	9,200	5,500	37,200
紫金礦業	279,100	93,600	40,400	332,300

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股行業龍頭指數ETF			
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	單位數目 2023年6月30日
地產建築				
安徽海螺水泥	42,700	10,700	6,100	47,300
中國交通建設	45,600	9,200	4,300	50,500
中國中鐵	178,900	46,100	26,100	198,900
中國建築	365,360	96,500	55,900	405,960
電訊				
中國移動	9,600	7,800	1,000	16,400
中國衛通集團	11,600	800	3,700	8,700
中國電信	300,600	76,100	42,700	334,000
中國聯通	359,800	91,400	74,800	376,400
公用事業				
中國核能電力	146,000	33,500	18,300	161,200
三峽能源	166,300	155,100	13,500	307,900
中國長江電力	176,140	77,800	50,200	203,740
華能國電	85,249	19,300	10,600	93,949
深圳證券交易所上市股票				
非必需性消費				
比亞迪	17,700	5,500	3,700	19,500
珠海格力電器	87,200	31,700	22,000	96,900
美的集團	94,500	20,400	9,100	105,800
必需性消費				
宜賓五糧液	37,600	11,500	7,300	41,800
益海嘉里	15,700	3,900	2,200	17,400
醫療保健				
邁瑞醫療	11,700	3,600	2,300	13,000
雲南白藥	13,880	3,500	1,900	15,480
工業				
寧德時代	26,100	39,600	4,200	61,500
立訊精密工業	89,300	24,600	14,200	99,700
順豐控股	42,700	11,600	6,900	47,400
資訊科技				
杭州海康威視數字技術	73,097	20,300	12,800	80,597
中興通訊	57,800	17,100	6,400	68,500
原材料				
榮盛石化	68,600	15,800	8,700	75,700
地產建築				
萬科企業	122,441	32,400	18,800	136,041
公用事業				
中國廣核電力	114,600	21,000	9,600	126,000

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生嘉實滬深300指數ETF			單位數目 2023年6月30日
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	
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	-	-	13,447,800

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數ETF			單位數目 2023年6月30日
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	
上海證券交易所上市股票				
非必需性消費				
中國國航	–	18,600	700	17,900
星宇股份	–	1,100	100	1,000
中國東方航空	–	36,800	–	36,800
中國南方航空	–	29,400	300	29,100
中國中免	–	8,600	–	8,600
科沃斯	–	1,700	100	1,600
福耀玻璃	–	9,600	100	9,500
長城汽車	–	8,300	100	8,200
廣汽集團	–	14,600	–	14,600
海爾智家	–	29,600	400	29,200
華域汽車	–	9,700	100	9,600
拓普集團	–	2,900	–	2,900
歐派家居	–	1,200	–	1,200
上汽集團	–	20,100	200	19,900
上海機場	–	7,400	100	7,300
錦江酒店	–	2,900	–	2,900
晨光股份	–	2,900	–	2,900
必需性消費				
重慶啤酒	–	1,600	100	1,500
東鵬飲料	–	700	100	600
海天味業	–	13,380	180	13,200
內蒙古伊利實業	–	40,900	500	40,400
今世緣	–	5,300	–	5,300
貴州茅臺酒	–	4,000	–	4,000
山西汾酒	–	3,300	–	3,300
水井坊	–	1,400	–	1,400
青島啤酒	–	2,100	–	2,100
能源				
中海油田服務	–	3,800	–	3,800

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數ETF			
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	單位數目 2023年6月30日
金融				
中國農業銀行	—	296,700	7,500	289,200
北京銀行	—	130,000	1,700	128,300
成都銀行	—	26,700	300	26,400
中國銀行	—	163,600	1,900	161,700
交通銀行	—	214,100	10,900	203,200
杭州銀行	—	24,100	300	23,800
江蘇銀行	—	99,200	1,300	97,900
南京銀行	—	70,900	900	70,000
上海銀行	—	77,800	1,000	76,800
中信銀行	—	26,600	400	26,200
中國建設銀行	—	53,200	700	52,500
中國光大銀行	—	188,300	21,600	166,700
中國銀河	—	11,000	200	10,800
中金公司	—	6,400	—	6,400
中國人壽保險	—	13,200	200	13,000
招商銀行	—	93,100	800	92,300
招商證券	—	29,100	400	28,700
中國民生銀行	—	279,900	10,500	269,400
中國太保	—	28,100	400	27,700
浙商銀行	—	138,390	17,100	121,290
中信証券	—	76,200	1,700	74,500
中信建投證券	—	15,700	300	15,400
光大證券	—	15,800	200	15,600
國泰君安	—	33,900	400	33,500
海通證券	—	74,100	1,000	73,100
華泰證券	—	45,900	600	45,300
華夏銀行	—	46,500	600	45,900
中國工商銀行	—	340,300	13,400	326,900
興業銀行	—	124,100	2,500	121,600
興業證券	—	55,300	700	54,600
新華保險	—	7,200	100	7,100
東方證券	—	41,200	500	40,700
中國人保	—	34,800	500	34,300
中國平安保險	—	69,400	1,200	68,200
中國郵政儲蓄銀行	—	128,400	24,500	103,900
浦發銀行	—	148,600	4,600	144,000
滬農商行	—	40,800	600	40,200
浙商證券	—	15,700	200	15,500
中泰證券	—	21,300	300	21,000

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數ETF			
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	單位數目 2023年6月30日
醫療保健				
同仁堂	–	4,900	100	4,800
萬泰生物	–	3,780	1,000	2,780
華熙生物	–	1,459	–	1,459
白雲山	–	4,800	–	4,800
金城醫學	–	2,100	100	2,000
江蘇恒瑞醫藥	–	26,400	500	25,900
上海復星醫藥	–	8,300	–	8,300
君實生物	–	2,573	–	2,573
通策醫療	–	1,500	–	1,500
藥明康德	–	12,800	100	12,700
片仔癀	–	2,300	100	2,200
工業				
航發動力	–	9,000	100	8,900
中航沈飛	–	5,600	–	5,600
中國船舶	–	16,100	–	16,100
中國能建	–	85,700	900	84,800
中遠海控	–	36,700	400	36,300
中國中車	–	73,900	700	73,200
大秦鐵路	–	36,900	400	36,500
福萊特玻璃	–	3,900	–	3,900
福斯特	–	6,020	120	5,900
恒立液壓	–	3,100	–	3,100
中天科技	–	20,800	200	20,600
隆基綠能科技	–	42,400	500	41,900
明陽智能	–	13,600	200	13,400
國電南瑞	–	27,200	200	27,000
德業股份	–	1,080	80	1,000
寧波港	–	25,800	200	25,600
容百科技	–	1,974	–	1,974
杉杉股份	–	9,100	100	9,000
三一重工	–	41,900	500	41,400
上海電氣	–	33,300	400	32,900
上港集團	–	23,600	200	23,400
璞泰來	–	8,590	–	8,590
生益科技	–	7,800	–	7,800
特變電工	–	22,800	200	22,600
通威股份	–	17,100	200	16,900
天合光能	–	9,325	–	9,325
上機數控	–	1,500	–	1,500
圓通速遞	–	16,300	200	16,100
正泰電器	–	7,800	–	7,800
時代電氣	–	1,797	–	1,797

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數ETF			
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	單位數目 2023年6月30日
資訊科技				
三六零	–	24,700	300	24,400
思瑞浦	–	535	–	535
中微公司	–	2,950	–	2,950
金山辦公	–	1,444	–	1,444
中國通號	–	15,983	200	15,783
華潤微	–	3,064	–	3,064
中科曙光	–	9,600	100	9,500
工業富聯	–	31,100	400	30,700
兆易創新	–	4,400	100	4,300
立昂微	–	3,300	–	3,300
士蘭微	–	6,100	100	6,000
恒生電子	–	10,700	100	10,600
長電科技	–	10,600	100	10,500
瀾起科技	–	5,813	–	5,813
中芯國際	–	11,934	–	11,934
實信軟件	–	4,800	–	4,800
傳音控股	–	2,530	–	2,530
斯達半導	–	500	–	500
上海韋爾半導體	–	7,100	200	6,900
聞泰科技	–	6,400	100	6,300
用友網絡	–	15,200	100	15,100
原材料				
寶山鋼鐵	–	48,300	500	47,800
中國巨石	–	15,900	200	15,700
中國化學	–	24,100	–	24,100
洛陽鉬業	–	54,700	6,600	48,100
合盛砂業	–	1,900	–	1,900
江西銅業	–	5,400	100	5,300
寶豐能源	–	13,800	200	13,600
山東黃金	–	10,700	200	10,500
華魯恒升	–	9,700	100	9,600
南山鋁業	–	39,300	400	38,900
三棵樹	–	1,260	–	1,260
桐昆股份	–	11,000	100	10,900
萬華化學	–	11,400	500	10,900
大全能源	–	3,315	–	3,315
華友鈷業	–	8,200	100	8,100
紫金礦業	–	100,800	–	100,800

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數ETF			
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	單位數目 2023年6月30日
地產建築				
安徽海螺水泥	–	13,100	100	13,000
中國交通建設	–	16,000	100	15,900
中國中鐵	–	61,600	600	61,000
中國鐵建	–	31,100	400	30,700
中國建築	–	126,000	1,300	124,700
金地集團	–	33,600	–	33,600
保利發展	–	68,400	100	68,300
新城控股	–	6,500	700	5,800
四川路橋	–	14,520	100	14,420
電訊				
中國移動	–	5,100	–	5,100
中國電信	–	101,100	1,000	100,100
中國聯通	–	113,600	1,200	112,400
公用事業				
中國核能電力	–	56,000	600	55,400
三峽能源	–	92,000	–	92,000
中國長江電力	–	66,300	5,600	60,700
新奧股份	–	6,000	–	6,000
華能水電	–	11,800	100	11,700
川投能源	–	8,400	100	8,300
深圳證券交易所上市股票				
非必需性消費				
比亞迪	–	6,100	100	6,000
長安汽車	–	31,400	300	31,100
一汽解放	–	6,400	100	6,300
分眾傳媒	–	84,800	1,000	83,800
珠海格力電器	–	34,200	400	33,800
華利集團	–	1,200	100	1,100
德賽西威	–	1,300	–	1,300
芒果超媒	–	6,000	100	5,900
TCL科技	–	96,910	1,010	95,900
蘇泊爾	–	1,300	–	1,300

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數ETF			
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	單位數目 2023年6月30日
必需性消費				
古井貢酒	–	900	–	900
海大集團	–	5,500	–	5,500
溫氏股份	–	37,100	400	36,700
雙匯發展	–	6,900	100	6,800
洋河股份	–	4,000	–	4,000
酒鬼酒	–	1,700	–	1,700
瀘州老窖	–	5,300	100	5,200
牧原股份	–	21,700	200	21,500
新希望	–	15,200	200	15,000
宜賓五糧液	–	13,200	100	13,100
金龍魚	–	5,400	100	5,300
貝泰妮	–	900	–	900
能源				
東方盛虹	–	15,100	–	15,100
美錦能源	–	17,800	–	17,800
金融				
寧波銀行	–	39,200	500	38,700
東方財富	–	105,700	1,300	104,400
廣發證券	–	23,100	300	22,800
國信證券	–	28,600	500	28,100
同花順	–	1,800	–	1,800
平安銀行	–	75,700	1,000	74,700
申萬宏源	–	90,400	11,200	79,200
醫療保健				
愛爾眼科	–	33,351	200	33,151
凱萊英	–	1,600	100	1,500
長春高新	–	2,200	100	2,100
智飛生物	–	9,250	100	9,150
泰格醫藥	–	5,000	–	5,000
華東醫藥	–	6,000	100	5,900
華蘭生物	–	6,800	–	6,800
愛美客	–	700	–	700
康泰生物	–	4,000	–	4,000
樂普醫療	–	8,300	–	8,300
歐普康視	–	3,300	–	3,300
康龍化成	–	3,900	–	3,900
上海萊士	–	34,400	400	34,000
邁瑞醫療	–	4,600	100	4,500
沃森生物	–	10,900	100	10,800
雲南白藥	–	5,200	–	5,200
新和成	–	10,400	100	10,300

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數ETF			單位數目 2023年6月30日
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	
工業				
鵬鼎控股	–	4,600	–	4,600
中航光電	–	7,150	–	7,150
中航西飛	–	10,100	1,100	9,000
京東方	–	219,000	2,200	216,800
三環集團	–	8,200	–	8,200
招商公路	–	13,000	–	13,000
振華科技	–	2,500	–	2,500
中偉股份	–	1,700	–	1,700
寧德時代	–	19,000	–	19,000
億緯鋰能	–	9,000	100	8,900
錦浪科技	–	1,300	–	1,300
歌爾股份	–	17,300	200	17,100
國軒高科	–	7,200	100	7,100
晶澳科技	–	11,840	–	11,840
先導智能	–	7,000	–	7,000
藍思科技	–	16,700	200	16,500
領益智造	–	19,000	200	18,800
立訊精密工業	–	31,800	300	31,500
順豐控股	–	15,100	200	14,900
深南電路	–	1,300	–	1,300
德方納米	–	1,440	40	1,400
匯川技術	–	12,700	100	12,600
陽光電源	–	8,200	100	8,100
欣旺達	–	9,300	100	9,200
邁為股份	–	1,120	20	1,100
視源股份	–	2,400	–	2,400
TCL中環	–	20,150	400	19,750
濰柴動力	–	35,800	400	35,400
高德紅外	–	14,530	100	14,430
徐工機械	–	43,900	600	43,300
金風科技	–	18,200	200	18,000
韻達股份	–	8,900	100	8,800
三花智控	–	13,000	–	13,000
中聯重科	–	43,900	500	43,400

投資組合變動表 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間

投資	恒生A股通低碳指數ETF			
	單位數目 2023年01月1日	增加	減少	單位數目 2023年6月30日
資訊科技				
三七互娛	–	13,900	200	13,700
科大訊飛	–	15,200	300	14,900
北京君正	–	1,900	–	1,900
浪潮信息	–	8,000	100	7,900
卓勝微	–	2,500	–	2,500
北方華創	–	2,100	–	2,100
納思達	–	5,700	–	5,700
深信服	–	2,200	100	2,100
聖邦股份	–	2,080	–	2,080
中科創達	–	2,300	–	2,300
紫光股份	–	11,400	100	11,300
紫光國微	–	4,300	–	4,300
億聯網絡	–	5,180	80	5,100
世紀華通	–	40,000	–	40,000
大華股份	–	14,100	200	13,900
晶盛機電	–	4,900	–	4,900
中興通訊	–	21,700	–	21,700
原材料				
中信特鋼	–	6,200	–	6,200
贛鋒鋳業	–	7,300	100	7,200
天賜材料	–	8,300	100	8,200
華峰化學	–	11,500	200	11,300
龍佰集團	–	9,200	800	8,400
聯泓新科	–	2,100	–	2,100
鹽湖股份	–	24,500	–	24,500
榮盛石化	–	21,500	300	21,200
衛星化學	–	14,100	3,400	10,700
天齊鋳業	–	7,200	–	7,200
恩捷股份	–	3,900	100	3,800
藏格礦業	–	6,800	–	6,800
地產建築				
北新建材	–	6,500	–	6,500
招商蛇口	–	22,800	300	22,500
萬科企業	–	51,500	600	50,900
華僑城A	–	30,500	5,800	24,700
天山股份	–	10,600	–	10,600
公用事業				
中國廣核電力	–	40,800	400	40,400
龍源電力	–	900	–	900
非上市供股權				
浙商銀行 (供股權)	–	27,990	27,990	–

簡明資產負債表 (未經審核)

2023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
	30-06-2023 (未經審核) (人民幣)	31-12-2022 (已經審核) (人民幣)	30-06-2023 (未經審核) (人民幣)	31-12-2022 (已經審核) (人民幣)	30-06-2023 (未經審核) (人民幣)
資產					
按公平價值列入收入或虧損的金融資產	152,022,721	129,240,138	53,105,362	53,172,601	123,115,909
應收股息分派款項	168,141	–	–	–	1,881
應收認購單位款項	1,079,991	–	–	–	–
其他應收款項	93	139	343,395	369,922	–
現金及現金等價物	794,734	662,057	107,491	58,375	–
資產總值	154,065,680	129,902,334	53,556,248	53,600,898	123,117,790
負債					
按公平價值列入收入或虧損的金融負債	–	–	–	–	7
銀行透支	–	–	–	–	636,711
應付單位持有人的收益分派款項	254,487	–	–	–	–
預提費用及其他應付款項	1,365,884	236,433	275,627	200,047	122,513
負債總值 (不包括屬於單位持有人之資產淨值)	1,620,371	236,433	275,627	200,047	759,231
屬於單位持有人之資產淨值	152,445,309	129,665,901	53,280,621	53,400,851	122,358,559
代表：					
金融負債 – 單位持有人之資產淨值	–	–	–	–	122,358,559
權益總值	152,445,309	129,665,901	53,280,621	53,400,851	–
已發行單位數目					
上市類別	3,203,901	2,820,666	2,700,000	2,700,000	5,100,000
非上市類別- A類 (人民幣) – 累積收益單位	–	–	–	–	498
非上市類別- A類 (港元對沖) – 累積收益單位	–	–	–	–	34,133
每單位資產淨值					
上市類別	47.5812	45.9700	19.7336	19.7781	24.1968
非上市類別- A類 (人民幣) – 累積收益單位	–	–	–	–	9.57
非上市類別- A類 (港元對沖) – 累積收益單位	–	–	–	–	8.91

簡明全面收入表 (未經審核)

截至2023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
	截至2023年 6月30日止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2022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2022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)
收入					
股息收入	2,215,623	1,941,777	–	–	1,423,129
利息收入	745	730	720	758	233
基金經理費用付償	–	–	267,704	251,124	115,461
其他收入	1,375	–	–	176	234,526
	2,217,743	1,942,507	268,424	252,058	1,773,349
費用					
核數師酬金	(24,345)	(31,007)	(72,256)	(48,792)	(6,547)
管理費	(385,920)	(377,008)	–	–	(59,150)
成立費用	–	–	–	–	(1,514,339)
登記處費	–	–	(6,943)	(6,943)	(3,748)
託管及銀行費用	(14,965)	(14,625)	(174)	(1,014)	(4,536)
雜項費用	(212,120)	(220,790)	(141,613)	(152,153)	(96,330)
投資交易費用	(61,496)	(42,252)	–	–	–
付予受託人之交易費	–	–	–	(90)	(63,070)
受託人費	(56,134)	(54,837)	(47,250)	(47,250)	(56,367)
估值費	–	–	(40,250)	(39,900)	–
	(754,980)	(740,519)	(308,486)	(296,142)	(1,804,087)
計算投資收益／(虧損) 前的收入／(損失)	1,462,763	1,201,988	(40,062)	(44,084)	(30,738)
投資收益／(虧損)					
投資淨收益／(虧損)	3,501,466	(14,131,336)	(67,239)	(6,099,738)	(5,570,047)
匯兌淨虧損	(14,528)	(6,147)	(12,924)	(1,598)	(3,432)
證券費用	(163,426)	(119,167)	–	–	(977)
	3,323,512	(14,256,650)	(80,163)	(6,101,336)	(5,573,479)
計算融資成本前的收入／(損失)	4,786,275	(13,054,662)	(120,225)	(6,145,420)	(5,604,217)
融資成本					
利息支出	(2)	–	(2)	(33)	(306)
稅前收入／(損失)	4,786,273	(13,054,662)	(120,227)	(6,145,453)	(5,604,523)
稅項	(208,663)	(194,645)	(3)	(3)	(142,775)
屬於單位持有人的收入／(損失) 及 期間總全面收入	4,577,610	(13,249,307)	(120,230)	(6,145,456)	(5,747,298)

簡明權益變動表／屬於單位持有人的資產淨值變動表 (未經審核)

截至2023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
	截至2023年 6月30日止半年 (未經審核) (人民幣)	截至2022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2022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)
期初餘額	129,665,901	158,632,876	53,400,851	74,089,104	–
屬於單位持有人的收入／(損失)及 期間總全面收入 與所有者(即單位持有人)的交易並直接於權 益上入賬	4,577,610	(13,249,307)	(120,230)	(6,145,456)	(5,747,298)
發行單位所得及應收款項	38,064,214	6,949,579	–	–	128,105,857
贖回單位所付及應付款項	(19,607,929)	(14,264,329)	–	(2,459,010)	–
予單位持有人的收益分派	(254,487)	(264,452)	–	–	–
與所有者(即單位持有人)的交易總額	18,201,798	(7,579,202)	–	(2,459,010)	128,105,857
期末餘額	152,445,309	137,804,367	53,280,621	65,484,638	122,358,559

簡明權益變動表／屬於單位持有之資產淨值變動表(未經審核)(續)

截至2023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
	截至2023年 6月30日止半年 (未經審核) (單位數目)	截至2022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2022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)
基金之已發行單位變動如下：					
上市類別：					
期初單位結餘	2,820,666	2,788,285	2,700,000	3,000,000	-
期間內發行單位數目	787,226	138,233	-	-	5,100,000
期間內贖回單位數目	(403,991)	(282,000)	-	(100,000)	-
期終單位結餘	3,203,901	2,644,518	2,700,000	2,900,000	5,100,000
非上市類別：					
A類(人民幣)－累積收益單位					
期初單位結餘	-	-	-	-	-
期間內發行單位數目	-	-	-	-	498
期間內贖回單位數目	-	-	-	-	-
期終單位結餘	-	-	-	-	498
A類(港元對沖)－累積收益單位					
期初單位結餘	-	-	-	-	-
期間內發行單位數目	-	-	-	-	34,133
期間內贖回單位數目	-	-	-	-	-
期終單位結餘	-	-	-	-	34,133

派息披露 (未經審核)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間與2022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				
2023年中期收益分派	29-06-2023	28-07-2023	0.08	254,487
2022年中期收益分派	23-06-2022	28-07-2022	0.10	264,452

指數及上市基金之表現 (未經審核)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間與2022年同期之比較

以人民幣計算之表現

基金／指數	由2023年1月1日至 2023年6月30日期間	由2022年1月1日至 2022年6月30日期間
恒生A股行業龍頭指數ETF* [△]	3.69%	-9.40%
恒生A股行業龍頭指數#	4.36%	-8.85%

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2023年1月1日至 2023年6月30日期間	由2022年1月1日至 2022年6月30日期間
恒生嘉實滬深300指數ETF* [△]	-0.20%	-8.41%
滬深300指數#	0.33%	-8.04%

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) (人民幣)
恒生A股通低碳指數ETF*	-3.21%
恒生A股通低碳精選指數#	-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。

* 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。

[△] 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。

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。

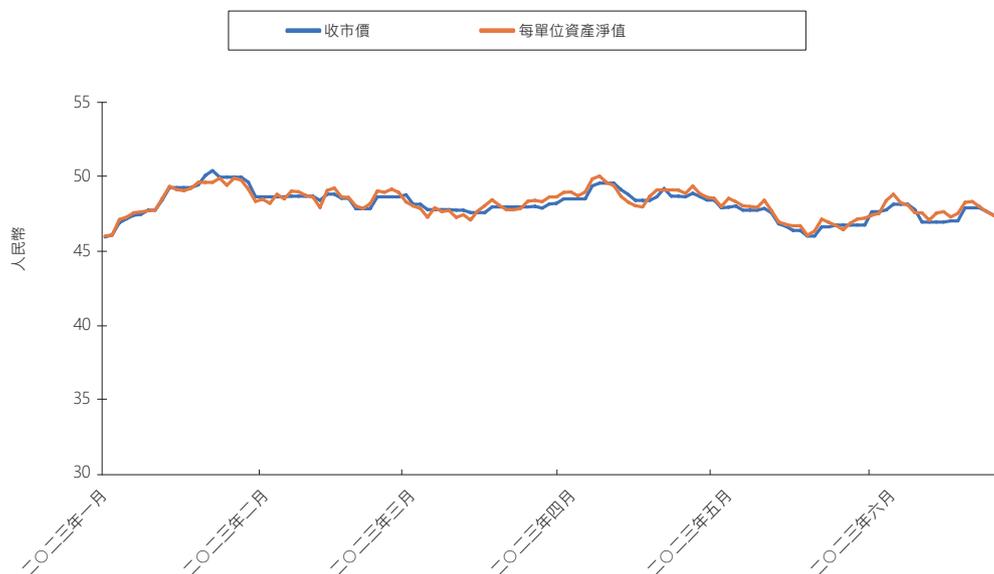
投資者須注意，所有投資均涉及風險(包括可能會損失投資本金)，基金單位價格可升亦可跌，過往表現並不可作為日後表現的指引。投資者在作出任何投資決定前，應詳細閱讀有關基金之銷售文件(包括當中所載之風險因素之全文)。

上市基金每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核)

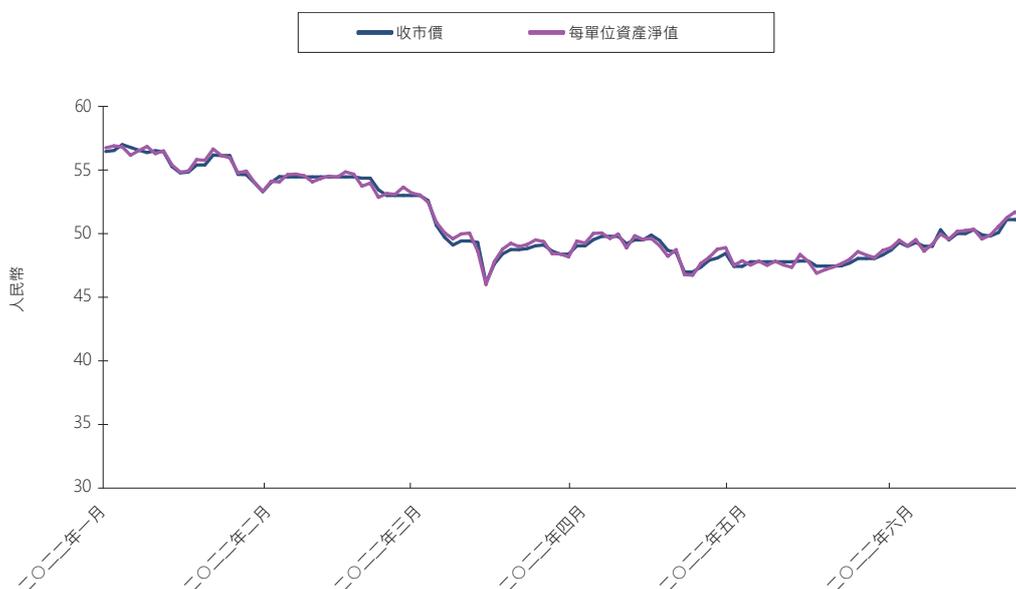
由2023年1月1日至2023年6月30日期間與2022年同期之比較

恒生A股行業龍頭指數ETF

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



由2022年1月1日至2022年6月30日之每日收市價及每單位資產淨值之比較

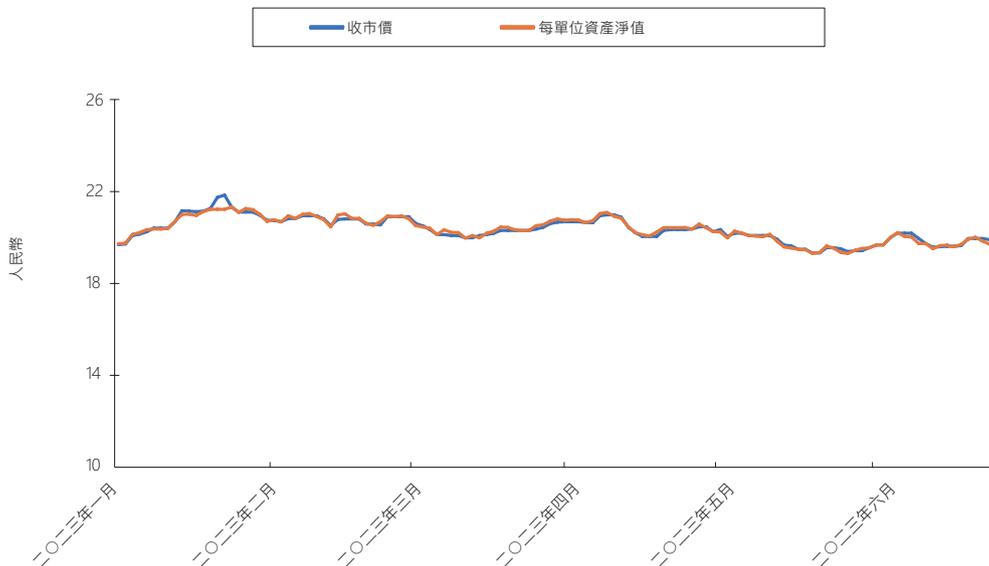


上市基金每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核) (續)

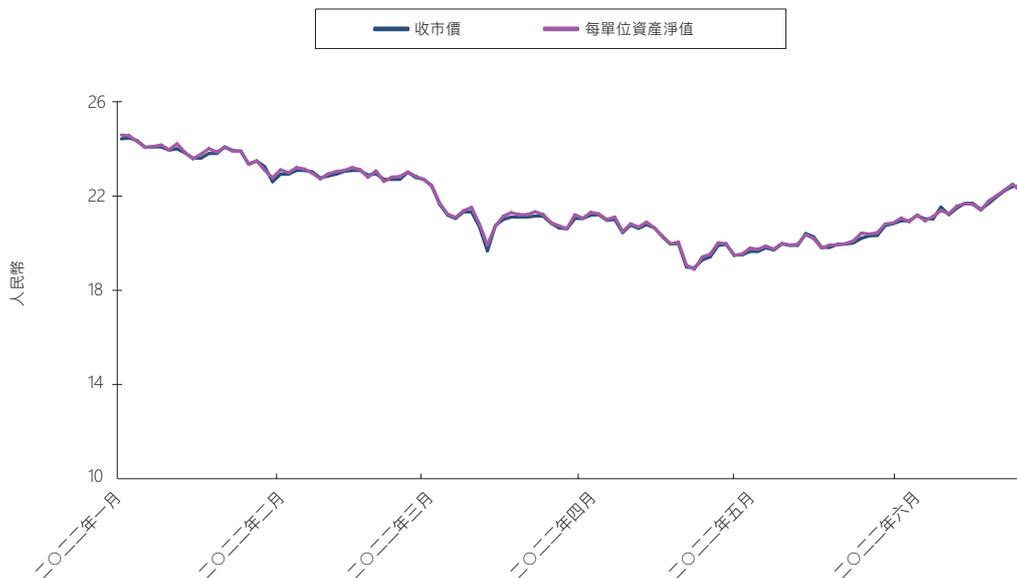
由2023年1月1日至2023年6月30日期間與2022年同期之比較

恒生嘉實滬深300指數ETF

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



由2022年1月1日至2022年6月30日之每日收市價及每單位資產淨值之比較

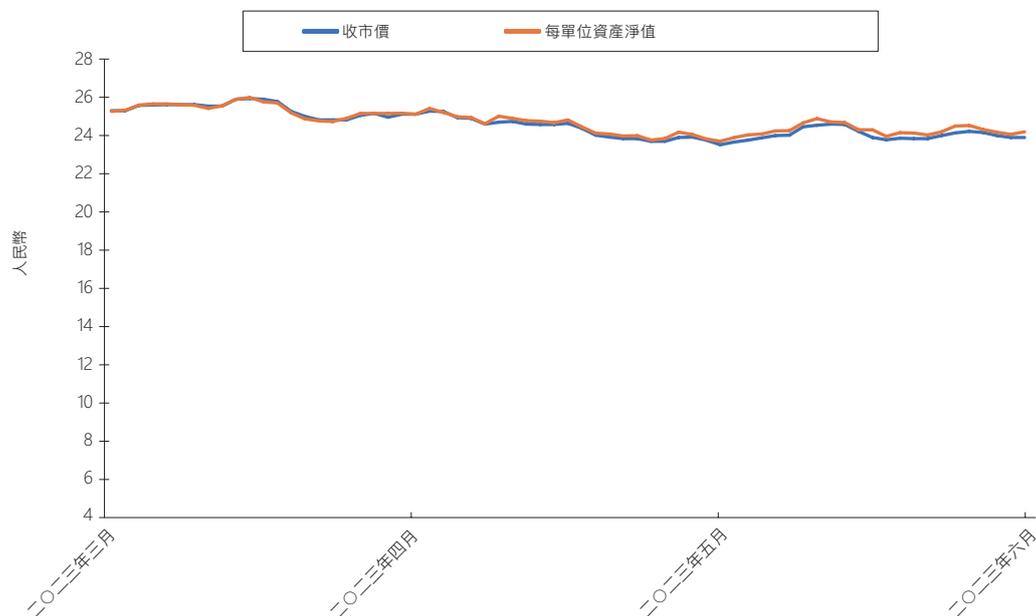


上市基金每日收市價及每單位資產淨值之比較 (未經審核) (續)

由2023年1月1日至2023年6月30日期間與2022年同期之比較

恒生A股低碳指數ETF

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



指數成份股披露 (未經審核)

2023年6月30日

下列為佔指數百分比多於十之成份股。

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	貴州茅臺酒	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。		

2022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	貴州茅臺酒	10.68%
恒生嘉實滬深300指數ETF	於2022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。		

上市基金就投資限制之報告 (未經審核)

2023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2023年1月1日至2023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股通低碳指數ETF (「子基金」) 中的權重可能會超過恒生A股通低碳指數中的權重，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2023年3月28日 (開始運作日期) 至2023年6月30日期間，基金經理在投資恒生A股通低碳指數ETF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、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）及上市代理人

恒生投資管理有限公司

香港

中環德輔道中83號

基金經理、RQFII持有人及上市代理人之董事

張家慧

趙蕙雯

李佩珊

李樺倫

蘇雪冰

薛永輝

曾慶強（已於2023年6月1日辭任）

WHITE Stuart Kingsley

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

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

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

核數師

畢馬威會計師事務所

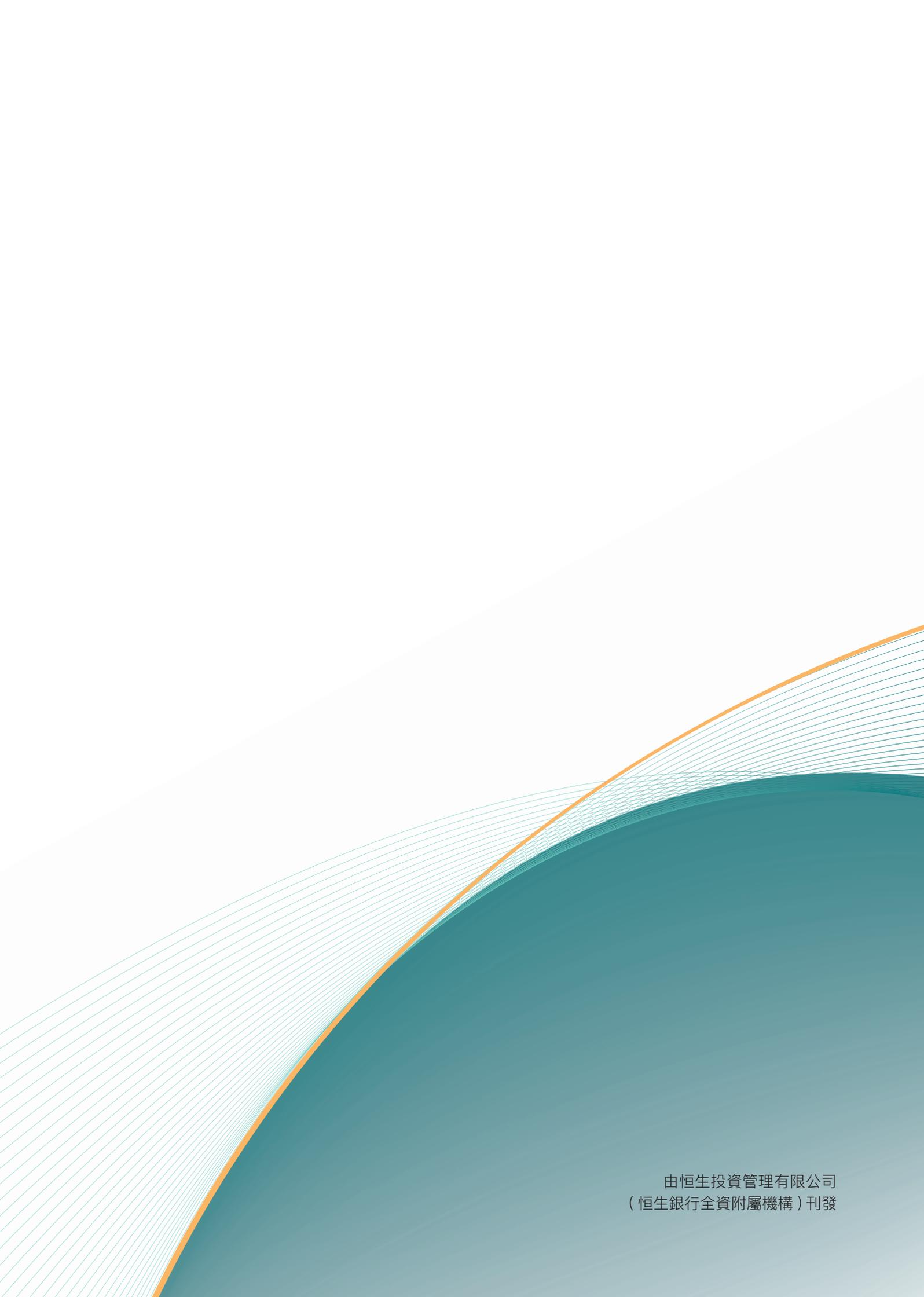
執業會計師

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



由恒生投資管理有限公司
(恒生銀行全資附屬機構) 刊發