



## 恒生投資指數基金系列 II 恒指 ESG 增強精選指數 ETF

2022 年 12 月

### 給予香港投資者的重要風險警告 / 基金資料

- 恒指 ESG 增強精選指數 ETF (「恒指 ESG ETF」) 的投資目標是旨在透過主要投資於恒指 ESG 增強精選指數 (「該指數」) 的成份證券，盡可能提供 (未計費用和開支前) 與該指數港元計值總回報表現 (扣除預扣稅後) 緊密相關的投資業績。
- 由於恒指 ESG ETF 主要投資的指數為新指數，該指數於 2021 年 11 月 29 日方才推出，因此，相對於追蹤較穩定、運作歷史較悠久之指數的其他指數基金而言，恒指 ESG ETF 的風險可能較高。
- 由於使用 ESG 標準構建該指數可能影響恒指 ESG ETF 的投資表現，因此，恒指 ESG ETF 的表現可能不同於不使用該標準的類似基金 (即恒指 ESG ETF 的投資可能集中在更重視 ESG 的公司)，因此，其價值波動可能比投資更加多元化的基金劇烈。此外，亦無法保證指數提供者基於數據供應商的數據作出的評估將反映實際情況，或所選股票將滿足 ESG 標準。由於現時 ESG 投資策略缺少標準化的分類法，基金就相關 ESG 因素或原則採用的披露標準可能不同。
- 恒指 ESG ETF 亦須承受投資風險、股票市場風險、集中及內地市場風險、與投資於同股不同權的公司有關的風險、與投資金融衍生工具相關的風險、中國稅項風險、交易風險、被動投資風險、依賴市場莊家的風險、追蹤誤差風險、終止風險及依賴同一集團的風險。
- 基金經理可酌情從恒指 ESG ETF 或實際從恒指 ESG ETF 資本<sup>^</sup>中作出派息，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。任何該等分派均可能導致每基金單位資產淨值即時減少。
- 投資涉及風險，投資者可能會損失其於恒指 ESG ETF 之投資的重大部分。

<sup>^</sup>基金經理可酌情從總收入中作出派息，而同時將基金的所有或部分費用及開支記入基金資本賬下 / 從基金資本中支付，這將導致基金可用作支付分派的可分派收益增加，因此基金實際上可從基金資本中作出派息。投資者不應只單獨基於本資料而作出投資決定，而應細閱恒指 ESG 增強精選指數 ETF 的相關附錄、產品資料概要及本系列的香港銷售文件 (包括當中所載之風險因素之全文)。

ESG 資料: 有關 (i) 如何在恒指 ESG ETF 的生命周期中衡量和監察 ESG 重點以及相關控制機制; (ii) 衡量 ESG 重點及該指數達致其 ESG 重點所採用的方法; (iii) 對恒指 ESG ETF 的相關資產之 ESG 相關屬性進行的盡職審查; 及 (iv) ESG 數據的來源和處理的額外資料，可於數據提供者之網址 <https://www.sustainalytics.com> (此網站內容未經證監會審核) 及指數提供者之網址 <https://www.hsi.com.hk> (此網站內容未經證監會審核) 瀏覽。基金經理的代理投票政策可於網址 <https://www.hangsenginvestment.com/en-hk/individual-investor/resources/> (此網站內容未經證監會審核) 瀏覽。

### 投資目標

本基金的投資目標乃透過主要投資於恒指 ESG 增強精選指數 (「該指數」) 的成份證券，盡可能提供 (未計費用和開支前) 與該指數港元計值總回報表現 (扣除預扣稅後) 緊密相關的投資業績。

### 累積表現

	三個月	六個月	一年	三年	五年	成立至今
港元櫃台	17.95%	-8.36%	N/A	N/A	N/A	-15.12%
指數	18.23%	-8.42%	N/A	N/A	N/A	-14.97%

### 年度表現

	年初至今	2021	2020	2019	2018	2017
港元櫃台	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
指數	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

### 基金表現



本基金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。(資產淨值由滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司提供。本基金之表現資料由基金經理提供)。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。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。指數是恒指 ESG 增強精選指數，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。(指數資料來源：恒生指數有限公司)。任續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	2022 年 2 月 22 日
上市日期	2022 年 2 月 24 日
追蹤指數	恒指 ESG 增強精選指數
報價貨幣	港元
基金經理	恒生投資管理有限公司
受託人	花旗信託有限公司
以實物形式/現金新增或贖回	最少 300,000 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 12.4084 港元
資產總值	7,817 萬港元
發行單位數量	6,300,000
所持股份數目	62
管理費	每年 0.08%
受託人費用	每年 0.03%

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

友邦保險	8.26%
香港交易所	8.15%
匯豐控股	7.63%
中國平安	6.54%
領展房產基金	5.01%
藥明生物	3.90%
新鴻基地產	3.89%
阿里巴巴	3.75%
李寧	3.68%
美團 - W	3.29%



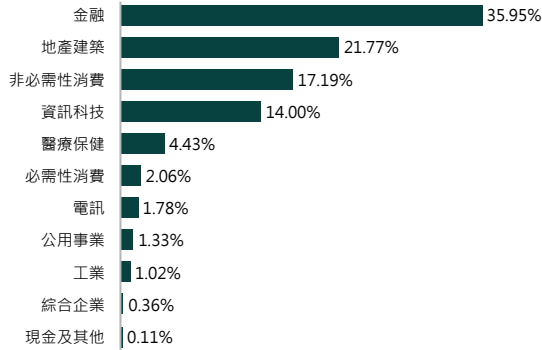
## 恒指 ESG 增強精選指數 ETF

2022 年 12 月

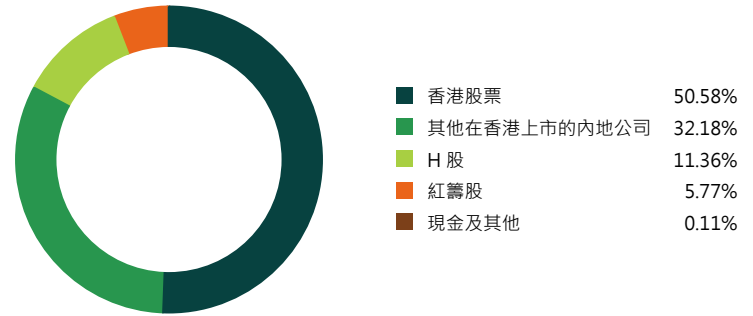
### 交易資訊

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	100	港元	HK0000822509	3136 HK	3136

### 行業分佈



### 股份類別分佈





## 恒指 ESG 增強精選指數 ETF

2022 年 12 月

### 參與經紀商名單+

Barclays Bank PLC  
BNP Paribas  
招商證券(香港)有限公司  
海通國際證券有限公司  
未來資產證券(香港)有限公司  
香港上海滙豐銀行有限公司

\* 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  
法國巴黎證券(亞洲)有限公司  
Flow Traders Hong Kong Limited  
Jane Street Asia Trading Limited  
Optiver Trading Hong Kong Ltd  
Vivienne Court Trading Pty. Ltd.

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

### 派息記錄

	派息頻率	記錄日	派息記錄
港元櫃台	每季(如有)	2022 年 12 月 19 日	0.04 港元

派息政策：由基金經理酌情作出每季現金分派(如有)(預期分別為就每曆年的各個日曆季度分派)。現時基金經理擬於每年 3 月、6 月、9 月及 12 月宣佈分派。各單位持有人將僅會收到港元分派。並不保證會定期分派及(如分派)所派發的金額。基金經理可酌情從本基金或實際從本基金資本<sup>^</sup>中作出分派。從資本中作出分派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。任何該等分派均可能導致每基金單位資產淨值(「資產淨值」)即時減少。

<sup>^</sup> 基金經理可酌情從總收入中作出派息，而同時將基金的所有或部分費用及開支記入基金資本帳下/從基金資本中支付，這將導致基金可用作支付分派的可分派收益增加。因此基金實際上可從基金資本中作出派息。

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	N/A	N/A
夏普比率	N/A	N/A

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

(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 2022 年 12 月 30 日。)

請閱讀本基金之銷售文件內有關該指數的免費聲明。本基金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本基金作出推介或認許，亦不是對本基金的商業利弊或表現作出保證，更不代表本基金適合所有投資者，或認許本基金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，並不構成建議買賣本基金基金單位的意見、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，應詳細閱讀本基金之銷售文件(包括當中所載之風險因素之全文(例如遇本基金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。