

---

本公告及通告乃重要文件，務請即時垂注，惟並不構成對下述交易所買賣基金單位的購入、購買或認購邀請或要約

---

如閣下對本公告及通告或所需採取的行動有任何疑問，應諮詢閣下的股票經紀、銀行經理、律師、會計師或其他財務顧問。

如閣下已出售或轉讓閣下在任何子基金所持有的所有基金單位，閣下應立即將本公告及通告交給買方或受讓人或經手處理有關銷售或轉讓的銀行、股票經紀或其他代理人再轉交買方或受讓人。

**重要提示：**香港聯合交易所有限公司（「香港聯交所」）、香港交易及結算所有限公司、香港證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）及香港中央結算有限公司（「香港結算」）對本公告及通告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何陳述，並表明拒絕就由於本公告及通告全部或任何部分內容而產生或因倚賴該等內容而引致之任何損失承擔任何責任。

貝萊德資產管理北亞有限公司（「管理人」）對本公告及通告所載資料的準確性於刊發之日承擔全部責任，並確認在已作出一切合理查詢後，據其所知及所信，本公告及通告於刊發之日並沒有遺漏其他事實，以致其任何申述具有誤導成分。

證監會認可不等如對計劃作出推介或認許，亦不是對計劃或其表現的商業利弊作出保證，更不代表計劃適合所有投資者，或認許計劃適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

## **iShares 安碩亞洲信託基金（「信託基金」）**

（根據香港法例第 571 章證券及期貨條例第 104 條  
獲認可之香港傘子單位信託基金）

**iShares 安碩滬深 A 股能源指數 ETF\*（\*此基金為一隻合成交易所買賣基金）**  
（股份代號：3050）（「滬深能源 ETF」）

**iShares 安碩滬深 A 股原材料指數 ETF\*（\*此基金為一隻合成交易所買賣基金）**  
（股份代號：3039）（「滬深原材料 ETF」）

**iShares 安碩滬深 A 股基建指數 ETF\*（\*此基金為一隻合成交易所買賣基金）**  
（股份代號：3006）（「滬深基建 ETF」）

**iShares 安碩滬深 A 股可選消費指數 ETF\*（\*此基金為一隻合成交易所買賣基金）**  
（股份代號：3001）（「滬深可選消費 ETF」）

**iShares 安碩滬深 A 股主要消費指數 ETF\*（\*此基金為一隻合成交易所買賣基金）**  
（股份代號：2841）（「滬深主要消費 ETF」）

（滬深能源 ETF、滬深原材料 ETF、滬深基建 ETF、滬深可選消費 ETF 及滬深主要消費 ETF 亦分別稱為信託基金的「子基金」，並統稱為「各子基金」）

# 有關建議停止交易、終止、 自願撤銷認可資格及除牌及 獲豁免嚴格遵守守則若干條文之 公告及通告

重要提示：強烈建議投資者考慮本公告及通告的內容。本公告及通告乃重要文件，務請即時垂注。其內容有關各子基金的建議停止交易、建議終止、建議撤銷認可資格及建議除牌以及於二零一六年十二月十九日（即停止交易日）至撤銷認可資格日期間獲豁免嚴格遵守守則若干條文的事宜。投資者尤須注意：

- 管理人經考慮相關因素後，當中特別包括各子基金相對較小的資產淨值（有關因素詳情見下文第1條），已透過管理人的董事會決議，決定根據信託契據第35.7(b)條規定行使其權力，終止各子基金，並自終止日起生效。管理人已向信託人發出書面通知，告知信託人其建議根據信託契據第35.7(b)條終止各子基金，而信託人並無反對該建議；
- 各子基金的基金單位的最後交易日將為二零一六年十二月十六日，即投資者可按照現行日常交易安排在香港聯交所買賣基金單位的最後一日及贖回基金單位的最後一日，但自二零一六年十一月二十一日日本公告及通告刊發後起將不准許透過任何參與證券商在一手市場增設基金單位；
- 各子基金的基金單位將於二零一六年十二月十九日（即停止交易日）起停止交易，即於停止交易日起將不可能再於香港聯交所買賣基金單位及贖回基金單位；
- 自停止交易日起：(i) 各子基金的基金單位將不再進行交易，亦不能再贖回各子基金的基金單位；(ii) 管理人將開始變現各子基金的所有資產，因此各子基金將不再追蹤基礎指數，亦將無法達致其追蹤有關基礎指數表現的投資目標；(iii) 各子基金將不再向公眾推廣；及(iv) 各子基金將主要持有現金，且將僅以有限方式營運；
- 為盡量減低在停止交易日後管理各子基金時的額外成本、費用及開支，並符合投資者的最佳利益，管理人已向證監會申請並已獲准自停止交易日至撤銷認可資格日期間獲豁免嚴格遵守守則的以下條文：(i) 第10.7章（有關刊登暫停交易的公告）；(ii) 附錄I第4、17(a)及17(b)段（有關按實時或接近實時基準提供估計資產淨值或「相關組合參考價值」(R.U.P.V.)及最後收市時的資產淨值）；及(iii) 第6.1及11.1B章（有關更新章程）。有關授出該豁免的詳情及條件在下文第5條說明；

- 管理人確認，除下文第 5.2 至 5.4 條所載守則的特定條文外，管理人將繼續遵守守則的所有其他適用條文、信託契據的適用條文及其他適用法例及法規，直至撤銷認可資格日為止；
- 管理人將於諮詢各子基金的核數師後，宣佈向截至二零一六年十二月三十一日（即分派記錄日）仍維持投資者身份的投資者派發末期分派（有關進一步資料，請參閱下文第 3.2 條），預期末期分派將於二零一七年二月八日（「末期分派日」）或前後支付。根據管理人於本公告及通告日期可得的資料，管理人認為於末期分派後將不太可能作出進一步分派。然而，在不太可能的情況下若在末期分派後作出進一步分派，管理人將發佈公告通知相關投資者；
- 在信託人與管理人已達成各子基金不再存有任何未償還的或有或實際負債或資產的意見之日，信託人與管理人將開始完成各子基金的終止事務（即終止日）；
- 於本公告及通告日期，就各子基金而言：(i) 管理人自所有 CAAP 發行人獲悉，其已向中國稅務機構就其相關中國資本增益稅報稅以供評估及中國稅務機構已完成有關評估；(ii) 管理人與所有 CAAP 發行人已協定並結算中國資本增益稅責任；及 (iii) 因此，管理人就其考慮專業稅務意見後所知所信，認為各子基金並無進一步中國資本增益稅責任；
- 自停止交易日起直至至少終止日為止期間，管理人將維持各子基金的證監會認可地位及各子基金在香港聯交所的上市地位，並在香港聯交所批准後，預期除牌將與撤銷認可資格同時或大約同時生效；
- 管理人將承擔自本公告及通告日期直至並包括終止日所有與各子基金終止相關的成本及費用（與子基金資產變現（即 CAAP 變現）有關的交易成本及任何稅款等正常營運開支除外，該等正常營運開支將由相關子基金承擔，亦即由其基金單位持有人承擔）。管理人將密切監控局勢，致力按各子基金及其基金單位持有人的利益並考慮成本後，以有序的方式變現 CAAP。在考慮有關成本時，管理人將致力確保有關成本就 (i) 擬於終止日前終止各子基金的意向及 (ii) 當時市場情況而言乃屬合理；
- 管理人預期撤銷認可資格及除牌將於終止日或終止日不久後進行（請注意：任何此前向投資者發行的各子基金產品文件，包括章程，應保留僅供個人使用，不能用於公開傳閱）；及
- 投資者應注意下文第 7.1 條所載的風險因素（包括流動性風險、CAAP 提早贖回及回購風險、基金單位按折價或溢價買賣及市場作價者失效的風險、自本公告及通告日期至最後交易日止期間的追蹤誤差風險、資產淨值下調風險、無法追蹤基礎指數風險及延遲分派風險）。投資者在買賣子基金基金單位或就子基金基金單位決定行動步驟前，應審慎行事並諮詢專業及財務顧問。

謹此促請股票經紀及財務中介機構：

- 將本公告及通告之副本轉交予其持有任何子基金的基金單位之客戶，並盡快告知其有關本公告及通告之內容；
- 為其擬於最後交易日或之前出售任何子基金的基金單位之客戶提供方便；及
- 就任何子基金的基金單位的出售提供服務時，如有任何適用的較早的交易截止時間、額外費用或收費及／或其他條款及條件，請盡快通告其客戶。

如投資者對本公告及通告之內容有任何疑問，應聯絡其獨立財務中介機構或專業顧問以尋求其專業意見，或直接向管理人查詢(有關進一步資料，請參閱下文第 10 條)。

管理人將每星期向投資者發出提示公告，就最後交易日、停止交易日及分派記錄日通知及提醒投資者，直至最後交易日為止。另外，管理人亦將於適當時候作出進一步公告，按照適用的監管規定及適當之情況就末期分派日、終止日、撤銷認可資格及除牌日以及末期分派後還有否任何進一步分派通知投資者。

管理人對本公告及通告所載資料的準確性承擔全部責任，並確認在已作出一切合理查詢後，據其所知及所信，本公告及通告並無遺漏其他事實，致使其任何申述具有誤導成分。

除另行定義外，本公告及通告所使用之詞彙及表達與在章程中所界定者具有相同涵義。

倘子基金之所有已發行基金單位之總資產淨值低於 10,000,000 美元的等值港元，信託基金及各子基金之管理人員萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)有權全權決定根據信託契據第 35.7(b) 條以書面形式通告信託人終止子基金。

截至二零一六年十一月十四日，各子基金各自之所有已發行基金單位之資產淨值低於 10,000,000 美元的等值港元。因此，管理人宣佈其已透過管理人董事會決議，決定終止各子基金，並自願申請各子基金之撤銷認可資格及除牌。建議終止、撤銷認可資格及除牌(即建議)須經證監會及香港聯交所最後批准，並將於信託人與管理人達成各子基金不再存有任何未償還的或有或實際負債或資產的意見之後完成。

在建議終止、撤銷認可資格及除牌前，各子基金的基金單位將自二零一六年十二月十九日(即停止交易日)起停止於香港聯交所交易。因此，各子基金的基金單位可於香港聯交所交易的最後一日將為二零一六年十二月十六日(即最後交易日)，而自停止交易日起，基金單位將不得在香港聯交所進行交易。此外，儘管投資者可於停止交易日前任何一個交易日繼續在香港聯交所買賣基金單位，但自二零一六年十一月二十一日起於本公告及通告刊登後，將不得透過參與證券商在一手市場增設基金單位。

管理人謹以本公告及通告敬告各投資者有關各子基金之建議終止。此外，謹此按照守則第 11.1A 章向投資者發出不少於一個月之通知，敬告投資者各子基金將自停止交易日起不再追蹤基礎指數並停止交易。

管理人將承擔自本公告及通告日期直至並包括終止日所有與各子基金終止相關的成本及開支（與子基金資產變現（包括 CAAP 變現）有關的交易成本及任何稅款等正常營運開支除外，該等正常營運開支將由相關子基金承擔，亦即由其基金單位持有人承擔）。

## 1. 建議終止各子基金、停止交易及變現資產

### 1.1 建議終止各子基金

根據信託契據第 35.7(b) 條，倘各子基金之所有已發行基金單位之總資產淨值低於 10,000,000 美元的等值港元，則各子基金可由管理人全權決定予以終止。信託契據並無規定根據信託契據第 35.7(b) 條終止一隻或多隻子基金須經投資者批准。

截至二零一六年十一月十四日，各子基金的資產淨值及每基金單位資產淨值如下：

子基金	資產淨值	每基金單位資產淨值
滬深能源 ETF	14,785,335 港元	5.91 港元
滬深原材料 ETF	11,845,253 港元	11.85 港元
滬深基建 ETF	25,570,382 港元	12.79 港元
滬深可選消費 ETF	33,160,068 港元	22.11 港元
滬深主要消費 ETF	60,733,096 港元	26.99 港元

管理人在考慮到投資者的整體利益、各子基金目前資產淨值相對較小及交投量偏低等相關因素後，認為建議終止各子基金將符合子基金有關投資者之最佳利益。因此，管理人已決定行使其於信託契據第 35.7(b) 條下之權力，以於信託人與管理人達成各子基金不再存有任何或有或實際資產或負債的意見之日終止各子基金。管理人已向信託人發出書面通知，告知信託人其根據信託契據第 35.7(b) 條建議終止各子基金，而信託人並無反對該建議。

### 1.2 建議停止交易

管理人將向香港聯交所申請自停止交易日（即二零一六年十二月十九日）起，各子基金的基金單位在香港聯交所停止交易。管理人將行使其於信託契據第 9.5 條下之投資權力，自二零一六年十二月十九日起擬將各子基金之全部資產變現。

管理人屆時將於二零一七年二月八日或其前後就各子基金作出末期分派（詳情見下文第 2.2 條）。因此，二零一六年十二月十六日將為投資者按照現行日常交易安排在香港聯交所買賣子基金的基金單位的最後交易日。

倘若本段所述的日期有任何變動，管理人將會登載有關更新日期之公告。

此外，鑒於停止交易之建議，將自二零一六年十一月二十一日起不得再透過參與證券商增設基金單位。

為免生疑，有關子基金的參與證券商將繼續獲准贖回任何子基金的基金單位，直至最後交易日為止。

投資者應注意，投資者不能在一手市場直接向子基金贖回基金單位。僅參與證券商可向管理人遞交贖回申請，而參與證券商可自行為其客戶設定申請程序及早於章程訂明之客戶申請截止時間。投資者應向參與證券商查詢有關截止時間及客戶受理程序及要求。

### 1.3 對建議變現資產之影響

CAAP 組成各子基金之大部分資產，因此，變現各子基金之資產將涉及 CAAP 之變現。變現 CAAP 的有關成本將由相關子基金承擔，亦即由其基金單位持有人承擔。如章程所披露，提前贖回 CAAP 可能會產生成本，有關成本將由相關子基金（亦即由其基金單位持有人）承擔—請參閱下文第 7.1 條「CAAP 提前贖回及回購風險」的風險因素。管理人將密切監控局勢，致力按各子基金及其基金單位持有人的利益並考慮成本後，以有序的方式實施變現。在考慮有關成本時，管理人將致力確保有關成本就 (i) 擬於終止日前終止各子基金的意向及 (ii) 當時市場情況而言乃屬合理。

在各子基金的資產變現後，各子基金將主要持有來自 CAAP 變現所得收益之現金。因此，自停止交易日起，各子基金將不再追蹤其基礎指數，亦將無法達致其追蹤基礎指數表現的投資目標。

## 2. 停止交易日之後會如何？

### 2.1 停止交易日之後的即時情況

自停止交易日起，各子基金的基金單位將在香港聯交所停止買賣，這意味投資者將僅可於二零一六年十二月十六日，即最後交易日（包括該日）前在香港聯交所買賣基金單位，而自停止交易日起將不可在香港聯交所買賣基金單位。

### 2.2 自停止交易日起至終止日期間

管理人將於諮詢各子基金的核數師後，就各子基金向於分派記錄日仍投資於各子基金的投資者（「**相關投資者**」），即該等並無在最後交易日或之前出售其於相關子基金的基金單位的投資者，宣佈末期分派。預期末期分派將於二零一七年二月八日或前後支付。

於終止日（預期將為二零一七年二月二十四日或前後），管理人及信託人將開始完成各子基金之終止事務。

自停止交易日起直至至少終止日為止期間，各子基金將繼續擁有香港聯交所上市地位，及各子基金將仍獲證監會認可，惟各自將僅以有限方式營運（如下文第 4.2 條所述）。因此，管理人已向證監會申請並已獲批准自停止交易日起至撤銷認可資格日期間獲豁免嚴格遵守守則的若干條文。有關授出該豁免的詳情及條件在下文第 5 條說明。

經證監會及香港聯交所分別批准後，撤銷認可資格及除牌將於終止日或終止日不久後進行。管理人預期（受限於香港聯交所批准），除牌將僅會於撤銷認可資格的同時或大約同時發生。

建議終止、撤銷認可資格及除牌將須在支付所有未償還費用及開支（有關進一步資料，請參閱下文第6條）、清償相關子基金所有未償還負債以及獲得證監會及香港聯交所最終批准後方可進行。

在撤銷認可資格後，各子基金將不再受證監會監管。任何此前向投資者發行的各子基金產品文件，包括章程，應保留僅供個人使用，不能用於公開傳閱。此外，股票經紀、財務中介機構及投資者不得向香港公眾人士傳閱與各子基金有關的任何推廣或其他產品文件，因此舉可能違反證券及期貨條例。

## 2.3 重要日期

於本公告及通告所載之建議安排分別獲證監會及香港聯交所批准後，預計各子基金之預期重要日期將如下：

寄發本公告及通告	二零一六年十一月十八日(星期五)
自該日起不再就各子基金增設基金單位	二零一六年十一月二十一日(星期一)
在香港聯交所買賣各子基金的基金單位的最後一日及參與證券商贖回各子基金的基金單位的最後一日(「最後交易日」)	二零一六年十二月十六日(星期五)
各子基金的基金單位在香港聯交所停止買賣(「停止交易日」)及不能進一步贖回各子基金的基金單位，即管理人開始將各子基金的全部資產變現及各子基金將不能再追蹤其基礎指數的同一日	二零一六年十二月十九日(星期一)
投資者須截至該日按香港結算記錄仍為以香港中央結算(代理人)有限公司名義登記及在中央結算系統持有子基金的基金單位的實益擁有人，才有權獲得末期分派及進一步分派(如有)(「分派記錄日」)	二零一六年十二月二十一日(星期三)
於諮詢各子基金的核數師後，向於分派記錄日仍持有基金單位的投資者支付末期分派(「末期分派日」)	二零一七年二月八日(星期三)或前後
各子基金之終止(「終止日」)	二零一七年二月二十四日(星期五)或前後，即管理人與信託人達成各子基金不再存有任何或有或實際資產或負債的意見之日。
各子基金撤銷認可資格及除牌	二零一七年二月二十四日(星期五)或前後，即證監會及香港聯交所分別批准撤銷認可資格及除牌之日。  管理人預期撤銷認可資格及除牌將於終止日或終止日不久後進行。

管理人將自本公告及通告日期起至最後交易日每星期發出提示公告，就最後交易日、停止交易日及分派記錄日通知及提醒投資者。此外，管理人亦將於適當時候發出進一步公告，按照適用的監管規定及適當之情況就各子基金的末期分派日、撤銷認可資格及除牌日、終止日以及末期分派後還有否任何進一步分派通知投資者。倘若本條所述的日期有任何變動，管理人將會登載公告通知相關投資者已更新的日期。

謹此促請所有股票經紀及財務中介機構將本公告及通告之副本連同任何其他公告轉交予其投資於各子基金的基金單位的客戶，並盡快告知其本公告及通告以及任何其他公告之內容。

### 3. 投資者於最後交易日或之前可能採取的行動

#### 3.1 於直至(及包括)最後交易日為止的任何交易日在香港聯交所買賣

於直至(及包括)最後交易日為止的任何交易日，投資者可繼續於香港聯交所的買賣時段內按照日常交易安排按當時市價在香港聯交所買賣其在各子基金的基金單位。各子基金的市場作價者將繼續按照香港聯交所的交易規則，就各子基金履行其市場作價的功能。

投資者應注意，股票經紀或其他財務中介機構可就於香港聯交所出售各子基金的基金單位對投資者收取經紀費，而基金單位的買賣雙方將各須支付交易徵費(各子基金的基金單位價格的0.0027%或其他適用比率)及交易費(各子基金的基金單位價格的0.005%)。

在香港聯交所出售或購買各子基金的基金單位毋須繳付香港印花稅。

各子基金的基金單位的成交價可能低於或高於相關子基金的每基金單位資產淨值。

#### 3.2 於最後交易日後持有基金單位

就於最後交易日後仍持有各子基金的基金單位的相關投資者而言，管理人將於諮詢各子基金的核數師後，就該等相關投資者宣派末期分派。每名相關投資者將可獲得款額相等於相關子基金的當時資產淨值按照其於分派記錄日所佔子基金的權益比例而派發的末期分派(「末期分派」)。相關子基金當時的資產淨值將為上文第1.3條所述相關子基金資產變現所得淨收益的總值。

就子基金向每名相關投資者支付的末期分派預期於二零一七年二月八日或前後存入其財務中介機構或股票經紀在中央結算系統開設的賬戶。管理人將於適當時候發出進一步公告，就子基金的末期分派的準確支付日期以及就子基金的每基金單位的末期分派額通知相關投資者。管理人預期或預計在末期分派後將不會作出進一步分派。然而，在不太可能的情況下若在末期分派後作出進一步分派，管理人將發佈公告通知相關投資者。

倘若本段所述的日期有任何變動，管理人將會登載公告通知相關投資者已更新的日期。



**重要提示：**投資者應留意及考慮下文第7.1條載列的風險因素，並在出售任何子基金的基金單位前諮詢其專業及財務顧問。倘投資者於最後交易日或之前任何時間出售其於任何子基金的基金單位，則在任何情況下該投資者將無權就任何已售出的子基金的基金單位享有相關子基金的末期分派的任何部分。因此，投資者在買賣子基金的基金單位或就其於子基金的基金單位決定行動步驟前，應審慎行事並諮詢其專業及財務顧問。

#### 4. 開始停止交易的後果

##### 4.1 各子基金繼續存續

各子基金將維持其證監會認可地位及其香港聯交所上市地位，直至撤銷認可資格及除牌之時為止。撤銷認可資格及除牌將於終止各子基金後盡快進行。

在信託人與管理人達成各子基金不再存有任何或有或實際資產或負債的意見之時，管理人與信託人將完成建議終止程序，管理人將就各子基金分別向證監會申請撤銷認可資格並向香港聯交所申請完成除牌手續。

##### 4.2 各子基金的有限營運

自停止交易日起直至撤銷認可資格為止之期間，各子基金將僅會以有限方式營運，原因是自停止交易日起，各子基金將不會再有任何基金單位的買賣，各子基金亦將不會有任何投資活動。

謹此提醒相關投資者聯絡其股票經紀或財務中介機構，核實其是否須就其自停止交易日起直至其停止持有基金單位之日止期間持有各子基金的基金單位承擔任何費用或收費(包括託管費)。

#### 5. 豁免

##### 5.1 背景

如上文第2.2條所載，儘管各子基金的基金單位將自停止交易日起停止交易，惟由於各子基金若干未償還的實際或有資產或負債，各子基金在停止交易日後直至終止日之期間將仍會存續。在該期間，各子基金將維持其證監會認可地位及其香港聯交所上市地位，直至建議終止、撤銷認可資格及除牌完成為止。

然而，於本公告及通告日期後，將不再增設基金單位，而自停止交易日起：(i)將不再進行基金單位交易，亦不能再贖回各子基金的基金單位；(ii)管理人將開始變現各子基金的所有資產，因此各子基金將不再追蹤其基礎指數。因而，各子基金將無法達致其各自追蹤其基礎指數表現的投資目標；(iii)各子基金將不再向公眾推廣；及(iv)各子基金將主要持有現金，並將僅會以有限方式營運。

因此，為盡量減低在停止交易日後管理各子基金時的額外成本、費用及開支，並符合投資者的最佳利益，管理人已向證監會申請並已獲准自停止交易日至撤銷認可資格日期間獲豁免嚴格遵守守則的若干條文。

有關獲豁免的詳情及條件載於本第5條。

## 5.2 刊登暫停交易通知

根據守則第10.7章，管理人須：(a)在子基金的基金單位停止或暫停交易時立即通知證監會；及(b)在作出暫停交易的決定後立即以適當的方式刊登有關通知，並在暫停交易期內至少每月刊登有關通知一次( (b)項規定稱為「投資者通知規定」)。

管理人已向證監會申請並已獲豁免嚴格遵守守則第10.7章下投資者通知規定(自停止交易日至撤銷認可資格日期間)，惟須符合以下條件：須自停止交易日起直至撤銷認可資格日為止的期間，於管理人網址內的顯著位置登載聲明，通知投資者各子基金的基金單位已於二零一六年十二月十九日起在香港聯交所停止交易，並請投資者注意本公告及通告及所有其他相關公告。

由於各子基金於最後交易日(二零一六年十二月十六日)後直至撤銷認可資格日仍維持其香港聯交所上市地位，投資者在該期間可繼續透過香港交易所網址及管理人網址查閱有關各子基金的進一步公告。此外，根據香港聯交所現行政策(可不時更改)，所有與各子基金有關的公告仍將登載於香港交易所網址，於除牌日後為期至少五年。

## 5.3 按實時或接近實時基準提供估計資產淨值或R.U.P.V.<sup>1</sup>及最後收市時的資產淨值

根據守則附錄一第4、17(a)及17(b)段，管理人須透過守則附錄一第18段所列任何適當渠道(包括各子基金本身的網址)，向公眾按實時或接近實時基準提供各子基金的估計資產淨值或R.U.P.V.及最後收市時的資產淨值，除非已另行獲豁免。

由於本公告及通告日期後將不再為各子基金增設基金單位，及自停止交易日起各子基金的基金單位將不再進行交易，亦不再進行贖回，以及各子基金將主要持有現金，並將僅會以有限方式營運，管理人建議及信託人同意，僅於發生任何導致資產淨值變動的情況下，方會在管理人網址更新各子基金的每基金單位資產淨值。管理人及信託人預期將會導致子基金的每基金單位資產淨值變動的情況包括：(i)末期分派(請參閱上文第3.2條)；(ii)進一步分派(如有)；及(iii)相關子基金的任何應收股息市值的任何變動。

因此，管理人已向證監會申請並已獲豁免嚴格遵守守則附錄一第4、17(a)及17(b)段下上述規定(自停止交易日至撤銷認可資格日期間)，惟須符合以下條件：

- (A) 各子基金截至二零一六年十二月十六日(即最後交易日)的每基金單位資產淨值，即將為各子基金的最近期可得的每基金單位資產淨值，將於管理人網址登載；及
- (B) 倘各子基金的資產淨值有任何其他變動，包括但不限於因下列各項引致的變動：(i)末期分派(請參閱上文第3.2條)；(ii)進一步分派(如有)；及(iii)相關子基金的任何應收股息股份市值的任何變動，管理人須於可行情況下盡快在管理人網址更新最近期可得的各子基金的每基金單位資產淨值。

<sup>1</sup> R.U.P.V. 指「相關組合參考價值」，於交易時段每15秒更新一次。

## 5.4 更新章程

根據守則第6.1及11.1B章，章程須為最新及須進行更新以併入對相關子基金的任何相關更改。

鑒於各子基金的基金單位於停止交易日起停止交易，且各子基金的基金單位不再增設或贖回，管理人認為毋須更新章程(其性質屬發售文件)以反映日後對各相關子基金的任何更改。

因此，管理人已向證監會申請並已獲豁免嚴格遵守守則第6.1及11.1B章下的上述規定(自停止交易日至撤銷認可資格日期間)，故於停止交易日起毋須更新章程。

在不影響管理人於守則第11.1B章下的其他責任之情況下，管理人已向證監會承諾及確認，管理人須：

(A) 就任何對各子基金或章程所作的更改，透過在管理人及香港聯交所網址登載公告(各為「日後相關公告」)的方式立即通知投資者；及

(B) 確保各日後相關公告均載明申述，請投資者參閱本公告及通告，並與章程及任何其他日後相關公告一併閱讀。

## 5.5 其他有關事項

管理人確認，除上文第5.2至5.4條所載守則的特定條文外，管理人將繼續就各子基金遵守守則的所有其他適用條文、信託契據的適用條文及其他適用法例及規例。

## 6. 成本

如上文第3.1條所示，投資者的股票經紀或財務中介機構可就任何於最後交易日或之前出售任何各子基金的基金單位的指示徵收若干費用及收費。

所有參與證券商贖回子基金的基金單位將均須繳付子基金之章程內列明的費用及成本。參與證券商可將該等費用及成本轉嫁予有關投資者。參與證券商亦可收取處理任何贖回要求的費用及收費，如此亦將增加贖回成本。投資者應向參與證券商查詢有關費用、成本及收費。

管理人將承擔自本公告及通告日期直至並包括終止日所有與各子基金終止相關的成本及費用(與子基金資產變現(即CAAP變現)有關的交易成本及任何稅款等正常營運開支除外，該等正常營運開支將由相關子基金承擔，亦即由其基金單位持有人承擔)。管理人將繼續收取管理費，直至並包括末期分派日。為完整性起見，倘末期分派日後有進一步分派，管理人將僅收取管理費，直至並包括末期分派日。

僅供 閣下參考，以下為在章程中披露的每年經常性開支\*：

- 滬深能源ETF的為1.18%；
- 滬深原材料ETF的為1.26%；
- 滬深基建ETF的為1.22%；
- 滬深可選消費ETF的為1.16%；
- 滬深主要消費ETF的為1.12%。

\* 經常性開支比率乃根據每隻子基金截至二零一五年十二月三十一日止年度的開支計算得出，以佔每隻子基金資產淨值的百分比列呈。

管理人預期各子基金的終止將不會影響上文所披露的經常性開支比率。請注意，為完整性起見，上文所示的經常性開支比率乃按照證監會有關通函下的指引計算，並不包括以下與各子基金終止有關的成本及開支（有關成本及開支將由各相關子基金承擔，亦即由其基金單位持有人承擔）：(i) 交易成本等正常營運開支（包括與變現CAAP有關的成本）及(ii) 與各子基金的資產變現有關於任何稅款。

於本公告及通告日期，各子基金概無任何未攤銷的初步開支或或有負債（如未決訴訟）。

## 7. 其他事項

### 7.1 建議停止交易、建議終止各子基金及建議撤銷認可資格及除牌的其他影響

鑒於本公告及通告及建議停止交易、建議終止各子基金及建議撤銷認可資格及除牌，投資者應注意及考慮以下各項風險：

**流動性風險**—自本公告及通告日期起，在香港聯交所買賣各子基金的基金單位可能出現流動性欠佳的情況。

**CAAP提前贖回及回購風險**—CAAP是由交易對手發行的證券，目的在於用合成方法複製A股投資。由於CAAP的合成性，該等CAAP的提早贖回可能會產生成本（其中包括，如子基金被終止的情況），該等成本可能顯著高於相關A股的交易成本，尤其在市場高度波動的時候。該等成本亦可隨時間變化而顯著變化。影響該等成本變化的因素包括A股市場波動、外匯市場波動以及與於到期日前贖回CAAP相關的成本，例如與CAAP相關的對沖平倉的成本。該等成本或會因市場情況的變動而變動，並在管理人的控制之外。因此，倘任一子基金終止，則向投資者支付由變現該子基金的CAAP投資產生的所得淨現金款項（如有）可能與A股的相關價值相差甚遠，從而導致投資者虧損。

**基金單位按折讓或溢價買賣及市場作價者失效的風險**—儘管直至最後交易日（包括該日）前，市場作價者將繼續按照香港聯交所的交易規則就各子基金履行其為市場作價的功能，各子基金的基金單位可在極端市場情況下以比較其資產淨值折讓的價格交易，此乃由於在建議公佈後，大部分投資者或計劃出售其於各子基金的基金單位，但市場中未必有很多願意購入該等基金單位的投資者。另一方面，各子基金的基金單位亦可能以溢價的價格交易，原因是自二零一六年十一月二十一日起將不會再增設新基金單位，因此，該等基金單位的供需失衡情況或會較平日更為嚴重。在該等極端市場情況下，市場作價者未必能有效地進行其市場作價的活動，以為各子基金的基金單位在香港聯交所買賣提供流動性。因此，自本公告及通告日期起直至最後交易日（包括該日），各子基金的基金單位的價格波動或會高於平日。

**自本公告及通告日期起至最後交易日止期間的追蹤誤差風險**—各子基金的規模有可能在最後交易日前大幅縮減。這或會損害管理人實現各子基金投資目標的能力，並導致重大的追蹤誤差。在極端情況下，倘相關子基金的規模縮減至管理人認為繼續投資於市場並不符合相關子基金的最佳利益，則管理人可決定將相關子基金的全部或部分投資轉換為現金或存款，以保障該子基金投資者的利益。

**資產淨值下調風險**—經濟環境、消費模式及投資者期望的轉變，可能對投資的價值產生重大影響，亦可能導致證券價值大幅下跌。

**無法追蹤基礎指數的風險**—管理人擬於停止交易日起將各子基金持有的所有CAAP變現。其後，各子基金的資產將主要為現金。各子基金將僅以有限方式營運。因此，自停止交易日起，各子基金將不再追蹤其基礎指數，亦將無法達致其追蹤基礎指數表現的投資目標。

**變現CAAP風險**—儘管各子基金持有之CAAP可能上市，惟CAAP並無活躍之二手市場。此外，管理人可能須與各CAAP發行人協定，在任何情況下，管理人將不會銷售任何CAAP予(i)任何台灣人士，或(ii)任何中國人士、中國公司、中國銀行或與CAAP相關A股之發行人之內部人士，或(iii)投資CAAP之資金產生自或源自中國之投資者，或(iv)任何其他未經CAAP發行人同意的當事人。此外，倘存在市場干擾事件或對沖干擾事件阻礙CAAP發行人變現相關對沖權益，管理人變現各子基金持有的CAAP的能力可能受到影響。

**延遲分派的風險**—管理人擬將各子基金的全部資產變現，其後在可行情況下盡快作出末期分派。然而，管理人未必能及時將各子基金的所有資產變現(例如，請參閱「變現CAAP風險」)。在此情況下，向相關投資者支付末期分派或會延遲。

投資者亦請注意章程中披露的各子基金的風險(見章程「風險因素」一節)，包括「投資者以溢價購買風險」。

## 7.2 稅務影響

根據管理人對於本公告及通告日期有效的法例及慣例的理解，由於信託基金及各子基金乃根據證券及期貨條例第104條獲認可的集體投資計劃，因此各子基金源自變現其資產的溢利可獲豁免香港利得稅。

就分派各子基金的溢利及／或資本的範圍內，投資者一般毋須就末期分派繳付香港利得稅。對在香港從事貿易、專業或業務的投資者而言，倘源自贖回或出售基金單位的溢利乃產生於或源自該等於香港的貿易、專業或業務，且基金單位屬投資者的收益資產，則有關溢利或須繳付香港利得稅。

投資者應就其個別稅務狀況諮詢其專業稅務顧問。

### 7.3 關連人士的交易

除下段所披露者外，概無任何管理人及／或信託人\*的關連人士涉及任何與各子基金有關的交易，或於各子基金中持有任何權益。

\* 請注意，香港上海滙豐銀行有限公司（「滙豐」）作為參與證券商，為信託人的關連人士，其可能不時持有各子基金大量的基金單位。在透過本公告及通告知悉建議後，滙豐可決定藉在香港聯交所出售基金單位或在一手市場贖回基金單位而出售其全部或部分基金單位。滙豐對基金單位的任何出售乃管理人無法控制，此舉或會大幅減低相關子基金的規模，損害管理人實現相關子基金投資目標的能力，並導致重大追蹤誤差。請參閱上文第 7.1 條「自本公告及通告日期起至最後交易日止期間的追蹤誤差風險」。

### 8. 中國資本增益稅

茲提述管理人於二零一五年十月三十日作出之公告（「資本增益稅公告」）。

如資本增益稅公告所載，管理人正就 CAAP 發行人對歸屬於買賣與各子基金持有的 CAAP 關連之 A 股的已變現資本收益所作預扣款項與各 CAAP 發行人聯絡，以確定與中國稅務機構最終確定 CAAP 發行人的中國資本增益稅責任時有否 (i) 任何 CAAP 發行人須向各子基金繳納的超額款項；或 (ii) 任何各子基金須向 CAAP 發行人繳納的差額。亦如資本增益稅公告所載，當與各 CAAP 發行人完成對賬程序，視乎各子基金之稅務撥備多於或少於可歸於各子基金的中國資本增益稅款項，各子基金之資產淨值可能作出若干重大（正面或負面）調整。

於本公告及通告日期，就各子基金而言：(i) 管理人自所有 CAAP 發行人獲悉，其已向中國稅務機構就其相關中國資本增益稅報稅以供評估及中國稅務機構已完成有關評估；(ii) 管理人與所有 CAAP 發行人已協定並結算中國資本增益稅責任；及 (iii) 因此，管理人就其考慮專業稅務意見後所知所信，認為各子基金並無進一步中國資本增益稅責任。

### 9. 備查文件

信託契據的副本可於管理人辦事處免費索閱，每套文件副本可以 150 港元向管理人購買。(i) 信託基金及各子基金的經審核賬目及未經審核半年度報告及 (ii) 章程的副本可由管理人免費提供。

### 10. 查詢

倘閣下對本公告及通告有任何疑問，請逕向閣下的股票經紀或財務中介機構提出，或於辦公時間（香港法定假日除外）致電 (852) 3903 2823 或電郵至 [iSharesAsiaEnquiry@blackrock.com](mailto:iSharesAsiaEnquiry@blackrock.com) 與管理人聯絡。

管理人對本公告及通告所載資料的準確性承擔全部責任，並確認在已作出一切合理查詢後，據其所知及所信，本公告及通告並無遺漏其他事實，致使其任何申述具有誤導成分。

#### 貝萊德資產管理北亞有限公司

作為信託基金及各子基金的管理人

二零一六年十一月十八日

## 11. 釋義

於本公告及通告內，除文義另有所指外，下列詞彙具有以下涵義：

CAAP	指	以美元為單位之中國A股連接產品，即為具章程所述之特點與(a)基礎指數所掛鉤或不掛鉤之A股；或(b)基礎指數掛鉤之衍生工具(例如認股權證、票據或參與證明)。
CAAP發行人	指	已同意向子基金發行及回購CAAP之具規模的財務機構。
中央結算系統	指	香港結算設立及運作之中央結算及交收系統或香港結算或其繼任者運作之任何接替系統。
資本增益稅	指	資本增益稅。
守則	指	證監會頒佈之單位信託及互惠基金守則(經不時修訂或取代)。
撤銷認可資格	指	由證監會根據證券及期貨條例第106條對各子基金及其各自的發售文件撤銷認可資格。
除牌	指	各子基金從香港聯交所除牌。
分派記錄日	指	二零一六年十二月二十一日，即旨在釐定有權獲得各子基金末期分派及相關子基金進一步分派(如有)的相關子基金的基金單位實益擁有人之日期。
末期分派	指	具有上文第3.2條賦予該詞的涵義。
末期分派日	指	二零一七年二月八日或前後，即相關子基金作出末期分派之日。
香港結算	指	香港中央結算有限公司或其繼任者。
投資者通知規定	指	具有上文第5.2條賦予該詞的涵義。
最後交易日	指	二零一六年十二月十六日，即在香港聯交所買賣子基金的基金單位的最後一日及參與證券商贖回子基金的基金單位的最後一日。
管理費	指	於章程中披露的管理費。
管理人	指	貝萊德資產管理北亞有限公司或其繼任者。
市場作價者	指	香港聯交所批准可於香港聯交所二手市場為各子基金的基金單位作價之經紀或證券商。

參與證券商	指	就任何子基金而言，任何獲香港結算認可(或已委任代理人，其獲香港結算認可)為中央結算系統的直接結算參與者或全面結算參與者(定義見中央結算系統一般規則)、及已簽訂參與協議的持牌經紀或證券商。
中國	指	中華人民共和國，不包括中華人民共和國香港特別行政區及中華人民共和國澳門特別行政區。
建議	指	有關終止各子基金及自願尋求撤銷認可資格及除牌的建議。
章程	指	日期為二零一六年十一月二十一日的各子基金綜合章程(包括產品資料概要)，經不時補充。
日後相關公告	指	具有上文第5.4條賦予該詞的涵義。
相關投資者	指	具有上文第2.2條賦予該詞的涵義。
香港聯交所	指	香港聯合交易所有限公司或其繼任者。
證監會	指	香港證券及期貨事務監察委員會或其繼任者。
證券及期貨條例	指	香港法例第571章證券及期貨條例。
終止日	指	二零一七年二月二十四日或前後，即信託人與管理人達成各子基金不再存有任何或有或實際資產或負債的意見之日。
停止交易日	指	二零一六年十二月十九日，即各子基金的基金單位在香港聯交所停止買賣之日。
信託契據	指	巴克萊國際投資管理北亞有限公司(現稱為貝萊德資產管理北亞有限公司)與信託人於二零零一年十一月十六日就構成信託基金所達成的信託契據，經不時修訂。
信託人	指	滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司或其繼任者。
基礎指數	指	就子基金而言，如章程所示之相關子基金之指標指數。
基金單位	指	就子基金而言，代表有關子基金之不可分割之股份。
基金單位持有人	指	子基金的基金單位持有人。