

## 報告及財務報表

### iShares安碩亞洲信託基金

- iShares安碩MSCI中國指數ETF
- iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF
- iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
- iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF (前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)
- iShares安碩核心MSCI亞洲 (日本除外) 指數ETF (前稱iShares安碩MSCI亞洲 (日本除外) 指數ETF)
- iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF
- iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)
- iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF
- iShares安碩核心MSCI 台灣指數ETF
- iShares安碩德國DAX指數ETF
- iShares安碩歐元區STOXX 50指數ETF
- iShares安碩富時100指數ETF
- iShares安碩納斯達克100指數ETF  
(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

# iShares安碩亞洲信託基金

## 目錄

管理人致基金單位持有人報告	3
信託人致基金單位持有人報告	33
管理人及信託人的責任聲明	34
獨立核數師報告	36
財務狀況報表	42
全面收入報表	47
基金單位持有人應佔資產淨值變動報表	52
現金流量報表	57
財務報表附註	62
<b>iShares安碩MSCI中國指數ETF</b>	<b>158</b>
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF</b>	<b>169</b>
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩富時A50中國指數ETF*(此基金為一隻合成交易所買賣基金)</b>	<b>193</b>
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
所持抵押品(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF(前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)</b>	<b>226</b>
投資組合(未經審核)	
iShares BSE SENSEX Mauritius Company 投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩核心MSCI亞洲(日本除外)指數ETF(前稱iShares安碩MSCI亞洲(日本除外)指數ETF)</b>	<b>230</b>
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	

# iShares安碩亞洲信託基金

## 目錄(續)

<b>iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF</b>	262
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩滬深300A股指數ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)</b>	285
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
所持抵押品(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF</b>	316
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩核心MSCI台灣指數ETF</b>	328
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩德國DAX指數ETF</b>	335
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩歐元區STOXX 50指數ETF</b>	338
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩富時100指數ETF</b>	343
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>iShares安碩納斯達克100指數ETF</b>	351
投資組合(未經審核)	
投資組合變動報表(未經審核)	
表現紀錄(未經審核)	
<b>管理及行政</b>	359

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金iShares安碩MSCI中國指數ETF(「MSCI中國ETF」)(「成分基金」)於二零零一年十一月二十三日推出，並自二零零一年十一月二十八日以股份代號2801開始在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。MSCI中國ETF是根據香港證券及期貨條例(第571章)經認可成立的香港單位信託基金。MSCI中國ETF以MSCI中國指數為指標指數。MSCI中國ETF的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

截至二零一六年十二月三十一日，MSCI中國ETF投資於香港聯交所上市的中國證券(包括H股、紅籌股及P股)、在上海證券交易所及深圳證券交易所上市的中國證券B股以及預託證券。根據中國企業所得稅法，MSCI中國ETF或須就買賣該等證券變現的資本增值繳納中國稅項。然而，基於下列原因管理人並未於財務報表中就該等收益產生的稅項計提撥備：管理人認為，根據現有的稅務法規，MSCI中國ETF可以維持不呈交稅務報表的現狀，且不大可能會徵收有關中國資本增值稅。

### 基金表現

MSCI中國ETF旨在提供在未扣除收費及開支前，與MSCI中國指數表現(以港元(「港元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，適用於一手市場增設及贖回的MSCI中國ETF的每單位資產淨值(「交易資產淨值」)為18.49港元，已發行單位為76,200,000個，成分基金總規模約為14億港元。

以下載列MSCI中國ETF<sup>(a)</sup>的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以港元計值) (截至十二月三十一日)	二零一六年	二零一五年	二零一四年	二零一三年	二零一二年	二零一一年	二零一零年	二零零九年	自成立以來 <sup>(f)</sup>
MSCI中國指數 <sup>(c)</sup>	0.94%	-7.88%	7.98%	3.68%	22.50%	-18.48%	4.89%	62.37%	11.46%
MSCI中國ETF資產淨值對 資產淨值 <sup>(d)</sup>	0.34%	-8.18%	7.33%	3.06%	21.46%	-18.87%	3.96%	59.16%	10.52%
MSCI中國ETF市場對市場 (MKT) <sup>(e)</sup>	-0.05%	-7.28%	6.98%	2.43%	21.88%	-18.99%	4.50%	56.86%	10.50%

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 此為基金成立以來的年化回報。成分基金於二零零一年十一月二十三日成立。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 基金表現

MSCI中國指數乃一個經自由流通量調整之市值加權指數，由摩根士丹利資本國際公司(MSCI Inc.)編製及公佈。MSCI中國指數的設計，是要追蹤(i)在香港聯交所上市的中國證券(包括H股、紅籌股及P股)；(ii)在上海證券交易所及深圳證券交易所上市的中國B股及(iii)於分類國家以外進行買賣的公司(即境外上市公司，包括以預託證券方式進行買賣的公司)股市表現。MSCI中國指數與MSCI中國ETF的表現不同主要是由於費用及開支以及證券比重錯配所致。

### 基金活動

根據彭博所報數字，MSCI中國ETF於本年度內的每日平均成交量約為179,453個單位。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI中國ETF包括76,200,000個已發行單位。

根據二零一六年十一月二十三日的股息公告，MSCI中國ETF宣派末期分派0.46港元。MSCI中國ETF之除息日期為二零一六年十二月十二日，記錄日期為二零一六年十二月十三日。分派已於二零一六年十二月二十八日支付。

### 指數活動

MSCI中國指數於本年度內進行過四次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI中國ETF持有MSCI中國指數所有成分股。

摩根士丹利資本國際公司(MSCI Inc.)已實施更改其MSCI環球可投資市場指數(「MSCI環球可投資市場指數」)的指數方法。由二零一五年十二月一日起生效，摩根士丹利資本國際公司增加了MSCI環球可投資市場指數的覆蓋範圍，把於分類國家以外進行買賣的公司(即境外上市公司)納入符合MSCI環球可投資市場指數的資格。若該等境外上市公司代表指數市值的重要比例可被納入，並可能包括預託證券如美國預託證券(「美國預託證券」)。因此，自二零一五年十二月一日起，MSCI中國ETF將可作為其投資策略一部分及為滿足其投資目標投資該等境外上市公司，包括美國預託證券。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF(「MSCI中國A股ETF」)(「成分基金」)於二零一六年一月二十五日推出，並自二零一六年一月二十八日以人民幣櫃檯股份代號83162及港元櫃檯股份代號3162在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。MSCI中國A股ETF是根據香港證券及期貨條例(第571章)經認可成立的香港單位信託基金。MSCI中國A股ETF以MSCI中國A股國際指數(「MSCI中國A股指數」)為指標指數。MSCI中國A股ETF的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

MSCI中國A股ETF可透過RQFII限額與股票市場交易互聯互通機制相結合的方式投資於中國A股。根據中國財政部(「財政部」)、中國證券監督管理委員會(「中國證監會」)及國家稅務總局(「國稅總局」)在國務院批准下發佈的財稅[2014]79號通知(「79號通知」)、財稅[2014]81號通知(「81號通知」)及財稅[2016]127號通知(「127號通知」)，向(i)QFII/RQFII；及(ii)透過股票市場交易互聯互通機制買賣A股的外國投資者於二零一四年十一月十七日或之後買賣A股產生的資本增值發出臨時納稅豁免。由於成分基金於該臨時豁免獲授出後開始營運，故並未於財務報表中就該等收益產生的稅項計提撥備。

### 基金表現

MSCI中國A股ETF旨在提供在未扣除收費及開支前，與MSCI中國A股指數表現(以人民幣(「人民幣」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI中國A股ETF的每單位交易資產淨值為人民幣6.29元，已發行單位為10,500,000個，成分基金總規模約為人民幣6,610萬元。

以下載列MSCI中國A股ETF<sup>(a)</sup>的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以人民幣計值)(截至十二月三十一日)	年初至今	自成立以來
MSCI中國A股指數 <sup>(c)</sup>	6.12% <sup>(f)</sup>	6.12% <sup>(f)</sup>
MSCI中國A股ETF資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	6.83% <sup>(f)</sup>	6.83% <sup>(f)</sup>
MSCI中國A股ETF市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	16.37% <sup>(g)</sup>	16.37% <sup>(g)</sup>

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 成分基金於二零一六年一月二十五日成立，並於二零一六年一月二十八日上市。

(g) 此為成分基金上市(二零一六年一月二十八日)以來的回報。

資料來源：貝萊德、MSCI Barra和WM/路透社

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 基金表現

MSCI中國A股指數乃自由流通經調整市值加權指數，由摩根士丹利資本國際公司(MSCI Inc.)編製及公佈。MSCI中國A股指數吸納深圳證券交易所及上海證券交易所的大中型公司，並包括MSCI中國全股指數的所有中國A股成分股。該指數於二零一四年六月二十六日推出。MSCI中國A股ETF將追蹤扣除股息預扣稅後的MSCI中國A股指數的總回報表現。MSCI中國A股指數與MSCI中國A股ETF的表現不同主要是由於MSCI中國A股ETF費用及開支以及證券比重錯配所致。

### 基金活動

根據彭博所報數字，MSCI中國A股ETF於本期間內的平均交投量約為16,096個單位。截至二零一六年十二月三十一日，已發行單位為10,500,000個。

根據二零一六年十一月二十三日的股息公告，MSCI中國A股ETF宣派末期分派人民幣0.12元。MSCI中國A股ETF之除息日期為二零一六年十二月十二日，記錄日期為二零一六年十二月十三日。分派已於二零一六年十二月二十八日支付。

### 指數活動

MSCI中國A股指數於本期間內進行過四次定期按季檢討。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI中國A股ETF持有MSCI中國A股指數的所有成分股。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金iShares安碩富時A50中國指數ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)(「A50中國ETF」)(「成分基金」)於二零零四年十一月十五日推出，並自二零零四年十一月十八日開始以股份代號2823在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。A50中國ETF是根據香港證券及期貨條例(第571章)經認可成立的香港單位信託基金。A50中國ETF以富時中國A50指數(「A50指數」)為指標指數。A50中國ETF的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

A50中國ETF可能投資A股、實質A股交易所買賣基金(「實質A股ETF」)以及衍生工具。該等衍生工具(即中國A股連接產品(「CAAP」))與A股或A股指數掛鈎，並擬提供相當於持有相關A股或A股指數的經濟效益。CAAP乃透過一名或多名合格境外機構投資者(「QFII」)或其聯屬公司(統稱「CAAP發行人」)所發行的。管理人分別於二零一三年八月二日、二零一四年九月一日、二零一四年十一月十四日及二零一六年十二月五日透過QFII額度、人民幣合格境外機構投資者(「RQFII」)額度滬港通及深港通，將其投資範圍擴大至包括代表A50中國ETF直接投資於A股。

自二零一三年八月十九日起，A50中國ETF可出於現金管理及應變目的將其資產淨值(「資產淨值」)的最多10%投資於實質A股ETF。截至二零一六年十二月三十一日止年度，A50中國ETF並無投資於任何實質A股ETF。

由二零一一年十月三十一日起，管理人須獲得至少佔A50中國ETF所承擔的全部交易對手總風險的100%的抵押品，以確保沒有未獲抵押的交易對手風險。此外，當抵押品的性質為股票證券時，該股票抵押品的市場價值應至少佔所對應之全部交易對手風險的120%。當抵押品的性質為非股票證券時，應採用謹慎的扣減政策。倘出現了管理人控制範圍以外的狀況而導致A50中國ETF無法符合完全抵押的情況，管理人將設法令有關額外抵押品在切實可行的情況下盡快交付予A50中國ETF，以遵守上述抵押要求。

根據自二零零八年一月一日起生效的中國企業稅法的一般稅務條文，非中國稅務常駐企業(例如QFII或RQFII)如其並無在中國設立中心管理及控制部門或擁有中國稅務機構，則須就源自中國的利息收入、股息及資本增值繳納10%的預扣稅。然而實際上，在近期發佈的財稅[2014]79號(「79號通知」)前，儘管中國國務院仍未就資本增值稅在中國企業所得稅法下作出任何特定所得稅豁免，但中國稅務機關並無積極就非中國稅務常駐企業出售A股徵收資本增值稅。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

根據中國財政部(「財政部」)、中國證券監督管理委員會(「中國證監會」)及國家稅務總局(「國稅總局」)在國務院批准下發佈的79號通知、財稅[2014]81號(「81號通知」)及財稅[2016]127號通知(「127號通知」)，分別向(i) QFII/RQFII；及(ii)透過股票市場交易互聯互通機制買賣A股的外國投資者於二零一四年十一月十七日或之後買賣A股產生的資本增值發出臨時納稅豁免。然而，79號通知亦明確訂明凡於二零一四年十一月十七日前由QFII/RQFII變現的任何收益須根據法律繳稅。

根據79號通知、81號通知及127號通知，管理人調整了A50中國ETF有關其於CAAP的相關中國投資及A股直接投資的撥備政策。截至二零一六年十二月三十一日，管理人已與所有CAAP發行人清算歸於A50中國ETF所投資CAAP的預扣增值稅(「增值稅」)款項。已對成分基金作出應計撥備與最終清算金額之間差額的調整。視乎A50中國ETF的預扣撥備多於或少於相關的增值稅款項，A50中國ETF的資產淨值(「資產淨值」)會作出調整。就A50中國ETF通過其QFII與RQFII限額作出的A股直接投資而言，A50中國ETF已向中國稅務機構申請於各項雙重稅務協定(「雙重稅務協定」)下的寬免並於其後獲得批准。因此，A50中國ETF於二零一五年十月二十九日的資產淨值已作出正面輕微調整，以反映稅務清算與撥備之間的調整。

有關該等調整的進一步詳情，請參閱管理人於二零一五年十月三十日、二零一五年十一月二十四日、二零一六年五月五日、二零一六年八月十二日、二零一六年八月十五日、二零一六年九月二十七日、二零一六年十月十二日、二零一六年十月二十五日、二零一六年十一月三日、二零一六年十一月十六日、二零一六年十二月十九日及二零一六年十二月二十日刊發的iShares安碩亞洲信託基金公告。

### 基金表現

A50中國ETF目標為提供在未扣除收費及開支前，與A50指數表現(以港元(「港元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，A50中國ETF的每單位交易資產淨值為10.86港元，已發行單位為2,654,000,000個，成分基金總規模約為288億港元。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

以下載列A50中國ETF<sup>(a)</sup>的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以港元計值) (截至十二月三十一日)	二零一六年	二零一五年	二零一四年	二零一三年	二零一二年	二零一一年	二零一零年	二零零九年	自成立以來 <sup>(f)</sup>
A50指數 <sup>(c)</sup>	-10.33%	-10.59%	67.53%	-8.94%	15.50%	-13.45%	-19.29%	85.76%	10.94%
A50中國ETF資產淨值對 資產淨值 <sup>(d)</sup>	-8.97%	-10.43%	61.21%	-12.25%	10.38%	-15.00%	-21.34%	80.93%	9.33%
A50中國ETF市場對市場 (MKT) <sup>(e)</sup>	0.00%	-14.29%	41.98%	-13.88%	9.66%	-17.50%	-13.75%	79.80%	9.05%

### 基金表現

自二零一四年二月四日起，成分基金追蹤計及中國A股股息10%預扣稅的淨總回報指數。成分基金過往追蹤總(稅)總回報指數。

A50指數由富時國際公司編製及公佈，包括市值最高之50間A股公司，並於二零零三年十二月十三日推出。此乃淨總回報指數，即將A50指數證券之淨股息再投資。A50指數乃按照指數提供者刊發之明確規則運作，且為具流動性之可買賣指數。此外，A50指數涵蓋上海及深圳市場。A50指數與A50中國ETF的表現不同主要是由於費用及開支(包括抵押品成本、股息稅及中國資本增值稅)，以及基金估值與指數計算所採用的匯率不同所致。

### 基金活動

根據彭博所報數字，A50中國ETF於本年度內的平均交投量約為62,300,000個單位。截至二零一六年十二月三十一日，已發行單位為2,654,000,000個。

根據二零一六年十一月二十三日的股息公告，A50中國ETF宣派末期分派0.30港元。A50中國ETF之除息日期為二零一六年十二月十二日，記錄日期為二零一六年十二月十三日。分派已於二零一六年十二月二十八日支付。

### 指數活動

A50指數於本年度內進行過四次定期按季檢討。截至二零一六年十二月三十一日，A50中國ETF持有A50指數的所有\*成分股。

\* A50中國ETF持有構成富時中國A50指數的所有成分股，其中1隻成分股以上市股本直接持有，49隻成分股以上市股本直接持有及透過CAAP間接持有。

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本成分基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 此為基金成立以來的年化回報。成分基金於二零零四年十一月十五日成立。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF (前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF(前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)(「SENSEX印度ETF」)(「成分基金」)於二零零六年十月三十一日推出，並自二零零六年十一月二日開始以港元櫃檯股份代號2836在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。SENSEX印度ETF自二零一六年十月十四日開始以美元櫃檯股份代號9836及人民幣櫃檯股份代號82836在香港聯交所買賣。SENSEX印度ETF是根據香港證券及期貨條例(第571章)經認可成立的香港單位信託基金。SENSEX印度ETF以標普BSE SENSEX指數(「SENSEX指數」)為指標指數。SENSEX印度ETF的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

於二零零九年六月之前，SENSEX印度ETF僅投資於衍生工具，該衍生工具(即印度連接產品(「IAP」))與對應印度股票掛鉤，並擬提供相當於持有對應印度股票的經濟效益。於二零零九年六月十日，除IAP外，管理人宣佈擬重組SENSEX印度ETF，以令其可直接投資於印度證券。重組涉及成立iShares BSE SENSEX Mauritius Company，一間於毛里求斯註冊成立並由SENSEX印度ETF全資擁有的附屬公司(「毛里求斯附屬公司」)，以投資於印度證券及/或IAP。重組已於二零零九年六月二十二日完成。

重組後：(a)毛里求斯附屬公司的相關投資，連同SENSEX印度ETF所進行的直接投資合計，均須遵守SENSEX印度ETF的投資限制；(b)由於管理人會向SENSEX印度ETF退還毛里求斯附屬公司所產生的一般費用及開支(IAP佣金除外)，故SENSEX印度ETF不會因毛里求斯附屬公司的成立而產生額外費用及開支；及(c)由於毛里求斯附屬公司不再於SENSEX印度ETF綜合入賬並按公平價值透過損益記賬，故就SENSEX印度ETF所須編製的各類報告將以單一實體形式編製。

重組後，SENSEX印度ETF可最多將資產淨值的15%投資於IAP，而於任何單一發行人的投資最多為其資產淨值的10%。如上所述，IAP為衍生工具，並不等同直接持有或投資於對應印度股票。

## 管理人致基金單位持有人報告

# iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 印度稅法變動

隨著二零一五至一六年金融法案的頒佈，反避稅總則(「反避稅總則」)將自二零一七年四月一日起實施。二零一七年印度預算案澄清，間接轉讓條文將不適用於由非居民直接或間接持有的屬於印度證券交易委員會(「SEBI」)登記類別 I 或類別 II FPI 範疇的任何資產。然而，目前尚未頒佈有關變動。

印度總統於二零一二年五月二十八日制定了二零一二至一三年金融法案，其中包括對一九六一年印度所得稅法(「所得稅法」)的主要稅務變更及闡明性修訂，主要尋求對間接(透過間接轉讓(具追溯性及前瞻性))及直接(透過引入反避稅總則轉讓印度證券徵收印度資本增值稅)。

於二零一六年五月十日，印度稅務局宣佈分階段取消印度－毛里求斯稅務協定項下現有的增值稅(「增值稅」)豁免。該變動將自二零一七年四月一日起生效，意味著於二零一七年四月一日或之後，印度有權對銷售由毛里求斯實體收購的印度居民公司股份徵收增值稅。於二零一七年四月一日前收購的股份毋須於印度繳稅。然而，分階段取消意指於二零一七年四月一日至二零一九年三月三十一日的過渡期間，稅率將以印度國內稅率的 50% 為限，並須遵守利益限制條款。於印度以全額國內稅率徵收稅項將適用於二零一九至二零二零年以後財政年度。管理人將繼續審閱協定變動及印度稅法變動對 SENSEX 印度 ETF 的影響。

因此，SENSEX 印度 ETF 持有印度投資而獲得的回報可能因此受到不利的影響。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF (前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 基金表現

SENSEX印度ETF目標為提供在末扣除收費及開支前，與SENSEX指數表現(以港元(「港元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，SENSEX印度ETF的每單位交易資產淨值為17.77港元，已發行單位為45,000,000個，成分基金總規模約為7.996億港元。

以下載列SENSEX印度ETF<sup>(a)</sup>的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以港元計值) (截至十二月三十一日)	二零一六年	二零一五年	二零一四年	二零一三年	二零一二年	二零一一年	二零一零年	二零零九年	自成立以來 <sup>(f)</sup>
SENSEX指數 <sup>(c)</sup>	0.89%	-8.15%	29.24%	-1.90%	23.80%	-35.76%	24.31%	92.00%	4.53%
SENSEX印度ETF資產淨值 對資產淨值 <sup>(d)</sup>	-0.01%	-9.04%	27.78%	-2.89%	22.57%	-36.38%	22.81%	87.00%	3.24%
SENSEX印度ETF市場對 市場(MKT) <sup>(e)</sup>	-0.68%	-10.51%	29.92%	-2.93%	21.33%	-35.94%	23.32%	84.85%	3.14%

SENSEX指數乃流通量調整市值加權指數，由孟買證券交易所(「孟買證券交易所」)成立之合資公司Asia Index Private Limited及標普道瓊斯指數有限責任公司編製及公佈，包括三十家於孟買證券交易所上市之最大型及交投最活躍之股份，為各個不同股份組別之代表。SENSEX指數與SENSEX印度ETF的表現不同主要是由於費用及開支，以及基金估值與指數計算所採用的匯率不同所致。

### 基金活動

根據彭博所報數字，SENSEX印度ETF於本年度內的每日平均交投量約為68,389個單位。截至二零一六年十二月三十一日，已發行單位總數為45,000,000個。

### 指數活動

SENSEX指數於本年度內進行過兩次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，SENSEX印度ETF透過毛里求斯附屬公司將所有或絕大部分資產投資於印度股本證券，投資比重大致與SENSEX指數股份的比重相同。

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。自二零一一年九月十四日起，指數提供者對自成立日期以來總回報指數之計算進行了調整。SENSEX指數於各比較期間之表現已相應予以重列。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 此為基金成立以來的年化回報。成分基金於二零零六年十月三十一日成立。

資料來源：貝萊德、Asia Index Private Limited和WM/路透社

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金 iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)(「MSCI 亞洲(日本除外)ETF」)(「成分基金」)於二零零九年三月十二日推出，並自二零零九年四月二十三日開始以港元櫃檯股份代號 3010 在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。MSCI 亞洲(日本除外)ETF 自二零一六年十月十四日開始以美元櫃檯股份代號 9010 及人民幣櫃檯股份代號 83010 在香港聯交所買賣。MSCI 亞洲(日本除外)ETF 是根據香港證券及期貨條例(第 571 章)經認可成立的香港單位信託基金。MSCI 亞洲(日本除外)ETF 以 MSCI 綜合亞洲除日本指數，及於二零一五年七月二十七日前以 MSCI 亞洲 APEX 50 指數為指標指數。MSCI 亞洲(日本除外)ETF 的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

自二零一五年七月二十七日起，基礎指數由 MSCI 亞洲 APEX 50 指數變更為 MSCI 綜合亞洲除日本指數。

### 基金表現

MSCI 亞洲(日本除外)ETF 目標為提供在末扣除收費及開支前，與 MSCI 綜合亞洲除日本指數，及於二零一五年七月二十七日前與 MSCI 亞洲 APEX 50 指數表現(以港元(「港元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI 亞洲(日本除外)ETF 的每單位交易資產淨值為 40.04 港元，已發行單位為 105,200,000 個，成分基金總規模約為 42 億港元。

以下載列 MSCI 亞洲(日本除外)ETF (a) 的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以港元計值) (截至十二月三十一日)	二零一六年	二零一五年	二零一四年	二零一三年	二零一二年	二零一一年	二零一零年	二零零九年	自成立以來
MSCI 綜合亞洲除日本指數 <sup>(c)</sup>	5.48%	-7.20%	不適用	不適用	不適用	不適用	不適用	不適用	12.25% <sup>(g)</sup>
MSCI 亞洲 APEX 50 指數 <sup>(c)</sup>	不適用	不適用	4.41%	6.34%	24.90%	-12.71%	15.70%	79.62% <sup>(f)</sup>	不適用
MSCI 亞洲(日本除外)ETF 資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	5.17%	-8.10%	3.88%	5.51%	24.25%	-13.45%	15.13%	78.15% <sup>(f)</sup>	11.49% <sup>(g)</sup>
MSCI 亞洲(日本除外)ETF 市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	5.79%	-8.41%	4.20%	6.01%	22.48%	-12.57%	15.42%	44.05% <sup>(h)</sup>	11.54% <sup>(i)</sup>

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。指數於二零一五年七月二十七日前由 MSCI 亞洲 APEX 50 指數變更為 MSCI 綜合亞洲除日本指數。成分基金於二零一五年七月二十七日之前所達致表現的環境不再適用。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表 閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 二零零九年的表現涵蓋自成分基金成立日期(二零零九年三月十二日)起至二零零九年十二月三十一日止期間。

(g) 此為基金成立以來的年化回報。成分基金於二零零九年三月十二日成立，並於二零零九年四月二十三日上市。

(h) 此為成分基金上市(二零零九年四月二十三日)以來的回報。

(i) 此為自基金成立以來的年化回報。成分基金的成立日期為二零零九年三月十二日。

資料來源：貝萊德、MSCI Barra 和 WM / 路透社

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩核心MSCI亞洲(日本除外)指數ETF (前稱iShares安碩MSCI亞洲(日本除外)指數ETF)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 基金表現

MSCI綜合亞洲除日本指數乃一個經自由流通量調整之市值加權指數，由摩根士丹利資本國際公司(MSCI Inc.)編製及公佈。MSCI綜合亞洲除日本指數的設計，是要吸納亞洲三大發展成熟市場國家中除日本外的兩個國家及八個新興市場國家的大中型公司。MSCI亞洲(日本除外)ETF將追蹤扣除股息預扣稅後的MSCI綜合亞洲除日本指數的總回報表現。

MSCI亞洲(日本除外)ETF主要投資於MSCI綜合亞洲除日本指數內的證券(包括預託證券)。其亦投資於(i) iShares安碩MSCI印度指數ETF(「新加坡MSCI印度ETF」，一隻於新加坡上市的ETF)及(ii) iShares安碩MSCI印度ETF(「美國MSCI印度ETF」，一隻於美利堅合眾國買賣並於BATS交易所(BATS Exchange, Inc.)第一上市的ETF)，以獲取投資於MSCI綜合亞洲除日本指數內印度證券(「印度成分股」)的機會。新加坡MSCI印度ETF及美國MSCI印度ETF未獲香港證券及期貨事務監察委員會(「證監會」)認可，不可供香港居民購買。無法保證新加坡MSCI印度ETF及美國MSCI印度ETF的表現，亦不保證彼等未來表現與印度成分股相關。MSCI亞洲(日本除外)ETF不會就持有MSCI印度ETF而須繳納額外管理費用。

MSCI綜合亞洲除日本指數與MSCI亞洲(日本除外)ETF的表現不同主要是由於費用及開支以及證券比重錯配所致。

### 基金活動

根據彭博所報數字，MSCI亞洲(日本除外)ETF於本年度內的每日平均成交量約為172,222個單位。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI亞洲(日本除外)ETF包括105,200,000個已發行單位。

根據二零一六年十一月二十三日的股息公告，MSCI亞洲(日本除外)ETF宣派末期分派0.27港元。MSCI亞洲(日本除外)ETF之除息日期為二零一六年十二月十二日，記錄日期為二零一六年十二月十三日。分派已於二零一六年十二月二十八日支付。

### 指數活動

MSCI綜合亞洲除日本指數於本年度內進行過四次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI亞洲(日本除外)ETF持有625\*隻成分股，MSCI綜合亞洲除日本指數則有626隻成分股。

摩根士丹利資本國際公司(MSCI Inc.)已實施更改其MSCI環球可投資市場指數(「MSCI環球可投資市場指數」)的指數方法。由二零一五年十二月一日起生效，摩根士丹利資本國際公司增加了MSCI環球可投資市場指數的覆蓋範圍，把於分類國家以外進行買賣的公司(即境外上市公司)納入符合MSCI環球可投資市場指數的資格。若該等境外上市公司代表指數市值的重要比例可被納入，並可能包括預託證券如美國預託證券(「美國預託證券」)。因此，自二零一五年十二月一日起，MSCI亞洲(日本除外)ETF將可作為其投資策略一部分及為滿足其投資目標投資該等在其所屬國家以外上市的境外上市公司，包括美國預託證券。

\* 於構成MSCI綜合亞洲除日本指數的626隻成分股中，MSCI亞洲(日本除外)ETF直接持有550隻成分股，及透過新加坡MSCI印度ETF間接持有75隻成分股。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金 iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF(「MSCI 亞洲新興市場 ETF」)(「成分基金」)於二零零九年三月十二日推出，並自二零零九年四月二十三日開始以股份代號 2802 在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。MSCI 亞洲新興市場 ETF 是根據香港證券及期貨條例(第 571 章)經認可成立的香港單位信託基金。MSCI 亞洲新興市場 ETF 以 MSCI 新興亞洲指數為指標指數。MSCI 亞洲新興市場 ETF 的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

### 基金表現

MSCI 亞洲新興市場 ETF 目標為提供在未扣除收費及開支前，與 MSCI 新興亞洲指數表現(以港元(「港元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI 亞洲新興市場 ETF 的每單位交易資產淨值為 39.75 港元，已發行單位為 3,000,000 個，成分基金總規模約為 1.193 億港元。

以下載列 MSCI 亞洲新興市場 ETF<sup>(a)</sup> 的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以港元計值) (截至十二月三十一日)	二零一六年	二零一五年	二零一四年	二零一三年	二零一二年	二零一一年	二零一零年	二零零九年	自成立以來
MSCI 新興亞洲指數 <sup>(c)</sup>	6.18%	-9.85%	4.91%	2.02%	20.58%	-17.52%	19.28%	93.32% <sup>(f)</sup>	11.58% <sup>(g)</sup>
MSCI 亞洲新興市場 ETF 資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	5.61%	-10.66%	5.12%	0.53%	18.34%	-15.33%	19.53%	92.02% <sup>(f)</sup>	11.23% <sup>(g)</sup>
MSCI 亞洲新興市場 ETF 市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	5.16%	-10.19%	4.76%	0.52%	18.07%	-14.95%	19.81%	50.02% <sup>(h)</sup>	11.17% <sup>(i)</sup>

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表 閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 二零零九年的表現涵蓋自成分基金成立日期(二零零九年三月十二日)起至二零零九年十二月三十一日止期間。

(g) 此為自基金成立以來的年化回報。成分基金於二零零九年三月十二日成立並於二零零九年四月二十三日上市。

(h) 此為自成分基金上市(二零零九年四月二十三日)以來的回報。

(i) 此為自基金成立以來的年化回報。成分基金的成立日期為二零零九年三月十二日。

資料來源：貝萊德、MSCI Barra 和 WM/路透社

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 基金表現

MSCI新興亞洲指數乃一個經自由流通量調整之市值加權指數，由摩根士丹利資本國際公司(MSCI Inc.)編製及公佈。MSCI新興亞洲指數的設計，是要追蹤亞洲新興市場國家股市之表現。MSCI亞洲新興市場ETF並非印度證券交易委員會(「SEBI」)註冊的外國組合投資者(「FPI」)，現正投資於iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF(前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)，以獲取參與MSCI新興亞洲指數於印度市場分部的投資。MSCI亞洲新興市場ETF不會就持有iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF(前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)而須繳納額外管理費用。MSCI新興亞洲指數與MSCI亞洲新興市場ETF的表現不同主要是由於費用及開支以及證券比重錯配所致。

### 基金活動

根據彭博所報數字，MSCI亞洲新興市場ETF於本年度內的每日平均交投量約為7,187個單位。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI亞洲新興市場ETF包括3,000,000個已發行單位。

根據二零一六年十一月二十三日的股息公告，MSCI亞洲新興市場ETF宣派末期分派0.70港元。MSCI亞洲新興市場ETF之除息日期為二零一六年十二月十二日，記錄日期為二零一六年十二月十三日。分派已於二零一六年十二月二十八日支付。

### 指數活動

MSCI新興亞洲指數於本年度內進行過四次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI亞洲新興市場ETF持有418\*隻成分股，MSCI新興亞洲指數則有554隻成分股。

摩根士丹利資本國際公司(MSCI Inc.)已實施更改其MSCI環球可投資市場指數(「MSCI環球可投資市場指數」)的指數方法。由二零一五年十二月一日起生效，摩根士丹利資本國際公司增加了MSCI環球可投資市場指數的覆蓋範圍，把於分類國家以外進行買賣的公司(即境外上市公司)納入符合MSCI環球可投資市場指數的資格。若該等境外上市公司代表指數市值的重要比例可被納入，並可能包括預託證券如美國預託證券(「美國預託證券」)。因此，自二零一五年十二月一日起，MSCI亞洲新興市場ETF將可作為其投資策略一部分及為滿足其投資目標投資該等在其所屬家以外上市的境外上市公司，包括美國預託證券。

\* 於構成MSCI新興亞洲指數的554隻成分股中，MSCI亞洲新興市場ETF直接持有390隻成分股，及透過SENSEX印度ETF間接持有28隻成分股。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)(「滬深300 A股ETF」)(「成分基金」)於二零零九年十一月十二日推出，並自二零零九年十一月十八日開始以股份代號2846在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。滬深300 A股ETF是根據香港證券及期貨條例(第571章)經認可成立的香港單位信託基金。滬深300 A股ETF以滬深300指數為指標指數。滬深300 A股ETF的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

於二零一六年十一月十八日，管理人宣佈滬深300 A股ETF的投資策略將作出變更，自二零一六年十一月二十一日(「生效日期」)起生效，當中引入「實質模擬」子策略，管理人意圖減少滬深300 A股ETF對「合成模擬」投資策略的依賴。「實質模擬」子策略包括透過以下渠道直接投資於A股：(i)股票市場交易互聯互通機制，當中滬深300 A股ETF透過旨在實現中國與香港證券交易所之間股票市場互通的證券交易及結算互聯互通機制直接投資於若干合資格A股；及(ii)管理人的聯屬公司BlackRock (Singapore) Limited(「RQFII資格持有人」)的RQFII限額，RQFII資格持有人將不時分配其RQFII限額供滬深300 A股ETF使用，以及出於現金管理及應變目的投資於實質A股ETF。於生效日期前，滬深300 A股ETF採納「合成模擬」投資策略，僅投資於CAAP或一系列CAAP及iShares安碩滬深行業指數基金\*。於二零一七年二月十七日，管理人宣佈滬深300 A股ETF已完成由「合成模擬」策略過渡至「實質模擬」策略，據此，其以持續基準持有A股及實質A股ETF(用於現金管理和應變目的)的總額佔其資產淨值達90%或以上。

根據證監會於二零一一年八月二十九日向滬深300 A股ETF施加的認可條件，管理人須就所有交易對手風險持有抵押品，旨在確保滬深300 A股ETF持有的抵押品須至少佔滬深300 A股ETF所承擔的全部交易對手之風險的100%。此外，倘滬深300 A股ETF接受的抵押品的性質為股票證券，滬深300 A股ETF將取得市場價值應至少為120%的抵押品。另外，就非股票抵押品而言，管理人須採用謹慎的扣減政策(「證監會抵押品條件」)。由於「合成模擬」策略已過渡至「實質模擬」策略，管理人已向證監會申請且獲得批准，除去證監會抵押品條件，自二零一七年二月二十八日起生效。自該日後，滬深300 A股ETF可能繼續會不時投資CAAP，但以無抵押品的基礎執行，且僅用於現金管理和應變目的。滬深300 A股ETF就現金管理和應變目的於CAAP的投資總額將不會超過滬深300 A股ETF資產淨值的10%。

\* iShares安碩滬深行業指數基金，指(i) 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)；(ii) 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)；(iii) iShares安碩滬深A股金融指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)；(iv) 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)；(v) 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)；及(vi) 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)。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

根據自二零零八年一月一日起生效的中國企業稅法的一般稅務條文，非中國稅務常駐企業(例如QFII或RQFII)如其並無在中國設立中心管理及控制部門或擁有中國稅務機構，則須就源自中國的利息收入、股息及資本增值繳納10%的預扣稅。然而實際上，在近期發佈的財稅[2014]79號(「79號通知」)前，儘管中國國務院仍未就資本增值稅在中國企業所得稅法下作出任何特定所得稅豁免，但中國稅務機關並無積極就非中國稅務常駐企業出售A股徵收資本增值稅。

根據中國財政部(「財政部」)、中國證券監督管理委員會(「中國證監會」)及國家稅務總局(「國稅總局」)在國務院批准下發佈的79號通知，向QFII/RQFII於二零一四年十一月十七日或之後買賣A股產生的資本增值發出臨時納稅豁免。然而，79號通知亦明確訂明凡於二零一四年十一月十七日前變現的任何收益須根據法律繳稅。

根據79號通知，管理人調整了滬深300 A股ETF有關其於CAAP的相關中國投資的撥備政策。截至二零一六年十二月三十一日，管理人已與所有CAAP發行人清算歸於滬深300 A股ETF所投資CAAP的預扣增值稅(「增值稅」)款項。已對成分基金作出應計撥備與最終清算金額之間差額的調整。視乎滬深300 A股ETF的預扣撥備多於或少於相關的增值稅款項，滬深300 A股ETF的資產淨值(「資產淨值」)會作出正面或負面調整。

有關該等調整的進一步詳情，請參閱管理人於二零一五年十月三十日、二零一五年十一月二十四日、二零一六年八月十二日、二零一六年十月十二日、二零一六年十月二十五日及二零一六年十二月二十日刊發的iShares安碩亞洲信託基金公告。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 基金表現

滬深300 A股ETF目標為提供在未扣除收費及開支前，與滬深300指數表現(以港元(「港元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，滬深300 A股ETF的每單位交易資產淨值為24.21港元，已發行單位為8,000,000個，成分基金總規模約為1.937億港元。

以下載列滬深300 A股ETF<sup>(a)</sup>的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以港元計值) (截至十二月三十一日)	二零一六年	二零一五年	二零一四年	二零一三年	二零一二年	二零一一年	二零一零年	二零一零年 <sup>(f)</sup>	自成立以來 <sup>(g)</sup>
滬深300指數 <sup>(c)</sup>	-15.21%	0.79%	54.92%	-2.54%	10.70%	-20.55%	-8.16%	2.21%	0.89%
滬深300 A股ETF資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	-15.77%	0.34%	51.18%	-6.62%	1.56%	-24.65%	-4.63%	2.37%	-1.60%
滬深300 A股ETF市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	-9.16%	-3.25%	38.99%	-10.74%	8.36%	-28.81%	-2.44%	2.15%	-2.45%

滬深300指數乃自由流通市值加權指數，由中證指數有限公司(「中證」)自二零零四年十二月三十一日起編製及公佈。滬深300指數包含在上海及深圳證券交易所買賣之300隻成分股之多元化指數。滬深300指數與滬深300 A股ETF的表現不同主要是由於費用及開支(包括抵押品成本、股息稅及中國資本增值稅)，以及基金估值與指數計算所採用的匯率不同所致。

自二零一四年二月四日起，成分基金追蹤計及中國A股股息10%預扣稅的淨總回報指數。成分基金過往追蹤總(稅)總回報指數。

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 二零零九年的表現涵蓋自成分基金成立日期(二零零九年十一月十二日)起至二零零九年十二月三十一日止期間。

(g) 此為自基金成立以來的年化回報。成分基金於二零零九年十一月十二日成立，並於二零零九年十一月十八日上市。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 基金活動

根據彭博所報數字，滬深300 A股ETF於本年度內的每日平均交投量約為16,303個單位。截至二零一六年十二月三十一日，滬深300 A股ETF包括8,000,000個已發行單位。

根據二零一六年十一月二十三日的股息公告，滬深300 A股ETF宣派末期分派0.44港元。滬深300 A股ETF之除息日期為二零一六年十二月十二日，記錄日期為二零一六年十二月十三日。分派已於二零一六年十二月二十八日支付。

### 指數活動

滬深300指數於本年度內進行過兩次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，滬深300 A股ETF持有298\*隻成分股，滬深300指數則有300隻成分股。

\*滬深300 A股ETF以上市股本直接持有85隻成分股、透過CAAP間接持有159隻成分股以及以上市股本直接持有及透過CAAP間接持有54隻成分股。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金 iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF(「韓國綜合股價 200 ETF」)(「成分基金」)於二零一六年六月二十二日推出，並自二零一六年六月二十九日開始以人民幣櫃檯股份代號 83170、美元櫃檯股份代號 9170 及港元櫃檯股份代號 3170 在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。韓國綜合股價 200 ETF 是根據香港證券及期貨條例(第 571 章)經認可成立的香港單位信託基金。韓國綜合股價 200 ETF 以 KOSPI 200 淨總回報美元指數為指標指數。韓國綜合股價 200 ETF 的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

### 基金表現

韓國綜合股價 200 ETF 目標為提供在未扣除收費及開支前，與 KOSPI 200 淨總回報美元指數表現(以美元(「美元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，韓國綜合股價 200 指數 ETF 的每單位交易資產淨值為 1.07 美元，已發行單位為 12,600,000 個，成分基金總規模約為 1,350 萬美元。

以下載列韓國綜合股價 200 ETF<sup>(a)</sup> 的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以美元計值)(截至十二月三十一日)	年初至今	自成立以來
KOSPI 200 淨總回報美元指數 <sup>(c)</sup>	0.89% <sup>(f)</sup>	0.89% <sup>(f)</sup>
韓國綜合股價 200 ETF 資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	1.73% <sup>(f)</sup>	1.73% <sup>(f)</sup>
韓國綜合股價 200 ETF 市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	4.68% <sup>(g)</sup>	4.68% <sup>(g)</sup>

KOSPI 200 淨總回報美元指數為根據於韓國股票市場上市的 200 間藍籌公司編製的自由流通調整市值加權指數，其成分股乃基於市場及行業代表性及流通性等因素挑選。KOSPI 200 淨總回報美元指數由韓國交易所計算及維持。KOSPI 200 淨總回報美元指數乃淨總回報指數，意指計算其表現時，以扣減稅項後之股息再投資為基準。

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 成分基金於二零一六年六月二十二日成立，並於二零一六年六月二十九日上市。

(g) 此為自成分基金上市(二零一六年六月二十九日)以來的回報。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF

( iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金 )

### 基金活動

根據彭博所報數字，韓國綜合股價 200 ETF 於本期間內的每日平均交投量約為 60,451 個單位。截至二零一六年十二月三十一日，韓國綜合股價 200 ETF 包括 12,600,000 個已發行單位。

### 指數活動

KOSPI 200 淨總回報美元指數於期間內進行過一次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，韓國綜合股價 200 ETF 持有 198 隻成分股，KOSPI 200 淨總回報美元指數則有 200 隻成分股。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金 iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF(「MSCI 台灣 ETF」)(「成分基金」)於二零一六年六月二十二日推出，並自二零一六年六月二十九日開始以人民幣櫃檯股份代號 83074、美元櫃檯股份代號 9074 及港元櫃檯股份代號 3074 在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。MSCI 台灣 ETF 是根據香港證券及期貨條例(第 571 章)經認可成立的香港單位信託基金。MSCI 台灣 ETF 以 MSCI 台灣指數為指標指數。MSCI 台灣 ETF 的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

### 基金表現

MSCI 台灣 ETF 目標為提供在未扣除收費及開支前，與 MSCI 台灣指數表現(以美元(「美元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI 台灣 ETF 的每單位交易資產淨值為 1.13 美元，已發行單位為 17,600,000 個，成分基金總規模約為 1,980 萬美元。

以下載列 MSCI 台灣 ETF<sup>(a)</sup> 的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以美元計值)(截至十二月三十一日)	年初至今	自成立以來
MSCI 台灣指數 <sup>(c)</sup>	9.57% <sup>(f)</sup>	9.57% <sup>(f)</sup>
MSCI 台灣 ETF 資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	9.31% <sup>(f)</sup>	9.31% <sup>(f)</sup>
MSCI 台灣 ETF 市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	9.99% <sup>(g)</sup>	9.99% <sup>(g)</sup>

MSCI 台灣指數為涵蓋台灣可投資股票範圍約 85% 公司的自由流通調整市值指數，按扣減稅項後之股息再投資後的淨總回報計算(須符合整體最小規模要求)。MSCI 台灣指數由 MSCI Inc 計算及維持。

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 成分基金於二零一六年六月二十二日成立，並於二零一六年六月二十九日上市。

(g) 此為自成分基金上市(二零一六年六月二十九日)以來的回報。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF

( iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金 )

### 基金活動

根據彭博所報數字，MSCI 台灣 ETF 於本期間內的每日平均成交量約為 242,730 個單位。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI 台灣 ETF 包括 17,600,000 個已發行單位。

根據二零一六年十一月二十三日的股息公告，MSCI 台灣 ETF 宣派末期分派 0.02 美元。MSCI 台灣 ETF 之除息日期為二零一六年十二月十二日，記錄日期為二零一六年十二月十三日。分派已於二零一六年十二月二十八日支付。

### 指數活動

MSCI 台灣指數於期間內進行過四次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，MSCI 台灣 ETF 持有 MSCI 台灣指數所有成分股。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金 iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF(「DAX ETF」)(「成分基金」)於二零一六年六月二十三日推出，並自二零一六年六月二十九日開始以人民幣櫃檯股份代號 83146、美元櫃檯股份代號 9146 及港元櫃檯股份代號 3146 在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。DAX ETF 是根據香港證券及期貨條例(第 571 章)經認可成立的香港單位信託基金。DAX ETF 以德國 DAX 指數為指標指數。DAX ETF 的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

### 基金表現

DAX ETF 目標為提供在未扣除收費及開支前，與德國 DAX 指數表現(以歐元(「歐元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，DAX ETF 的每單位交易資產淨值為 1.05 歐元，已發行單位為 5,800,000 個，成分基金總規模約為 610 萬歐元。

以下載列 DAX ETF<sup>(a)</sup> 的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以歐元計值)(截至十二月三十一日)	年初至今	自成立以來
德國 DAX 指數 <sup>(c)</sup>	11.93% <sup>(f)</sup>	11.93% <sup>(f)</sup>
DAX ETF 資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	11.82% <sup>(f)</sup>	11.82% <sup>(f)</sup>
DAX ETF 市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	14.08% <sup>(g)</sup>	14.08% <sup>(g)</sup>

德國 DAX 指數為追蹤法蘭克福證券交易所之 30 家最大且最重要公司(稱為藍籌公司)的部分的自由流通調整市值加權指數。德國 DAX 指數由 Deutsche Börse AG 計算及維持。德國 DAX 指數乃合計總回報指數，意指計算其表現時，以扣減稅項前之股息再投資為基準。

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本成分基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 成分基金於二零一六年六月二十三日成立，並於二零一六年六月二十九日上市。

(g) 此為自成分基金上市(二零一六年六月二十九日)以來的回報。

資料來源：貝萊德、MSCI Barra 和 WM/路透社

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF

( iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金 )

### 基金活動

根據彭博所報數字，DAX ETF 於本期間內的每日平均成交量約為 80,107 個單位。截至二零一六年十二月三十一日，DAX ETF 包括 5,800,000 個已發行單位。

### 指數活動

德國 DAX 指數於期間內進行過一次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，DAX ETF 持有德國 DAX 指數所有成分股。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩歐元區 STOXX 50 指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金 iShares 安碩歐元區 STOXX 50 指數 ETF(「歐元區 STOXX 50 ETF」)(「成分基金」)於二零一六年六月二十三日推出，並自二零一六年六月二十九日開始以人民幣櫃檯股份代號 83155、美元櫃檯股份代號 9155 及港元櫃檯股份代號 3155 在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。歐元區 STOXX 50 ETF 是根據香港證券及期貨條例(第 571 章)經認可成立的香港單位信託基金。歐元區 STOXX 50 ETF 以歐元區 STOXX 50 指數為指標指數。歐元區 STOXX 50 ETF 的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

### 基金表現

歐元區 STOXX 50 ETF 目標為提供在未扣除收費及開支前，與歐元區 STOXX 50 指數表現(以歐元(「歐元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，歐元區 STOXX 50 ETF 的每單位交易資產淨值為 1.02 歐元，已發行單位為 5,000,000 個，成分基金總規模約為 510 萬歐元。

以下載列歐元區 STOXX 50 ETF<sup>(a)</sup> 的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以歐元計值)(截至十二月三十一日)	年初至今	自成立以來
歐元區 STOXX 50 指數 <sup>(c)</sup>	8.93% <sup>(f)</sup>	8.93% <sup>(f)</sup>
歐元區 STOXX 50 ETF 資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	8.79% <sup>(f)</sup>	8.79% <sup>(f)</sup>
歐元區 STOXX 50 ETF 市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	11.47% <sup>(g)</sup>	11.47% <sup>(g)</sup>

歐元區 STOXX 50 指數為自由流通調整市值加權指數。其代表 12 個歐元區國家內按自由流通市值計算的最大 50 間公司。歐元區 STOXX 50 指數由勢拓有限公司計算及維持。歐元區 STOXX 50 指數乃淨總回報指數，意指計算其表現時，以扣減稅項後之股息再投資為基準。

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表 閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 成分基金於二零一六年六月二十三日成立，並於二零一六年六月二十九日上市。

(g) 此為自成分基金上市(二零一六年六月二十九日)以來的回報。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩歐元區 STOXX 50 指數 ETF

( iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金 )

### 基金活動

根據彭博所報數字，歐元區 STOXX 50 ETF 於本期間內的每日平均交投量約為 95,618 個單位。截至二零一六年十二月三十一日，歐元區 STOXX 50 ETF 包括 5,000,000 個已發行單位。

### 指數活動

歐元區 STOXX 50 指數於期間內進行過一次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，歐元區 STOXX 50 ETF 持有歐元區 STOXX 50 指數所有成分股。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩富時 100 指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金 iShares 安碩富時 100 指數 ETF(「富時 100 ETF」)(「成分基金」) 於二零一六年六月二十三日推出，並自二零一六年六月二十九日開始以人民幣櫃檯股份代號 82847、美元櫃檯股份代號 9847 及港元櫃檯股份代號 2847 在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。富時 100 ETF 是根據香港證券及期貨條例(第 571 章)經認可成立的香港單位信託基金。富時 100 ETF 以富時 100 指數為指標指數。富時 100 ETF 的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

### 基金表現

富時 100 ETF 目標為提供在未扣除收費及開支前，與富時 100 指數表現(以英鎊「英鎊」計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，富時 100 ETF 的每單位交易資產淨值為 0.83 英鎊，已發行單位為 4,800,000 個，成分基金總規模約為 400 萬英鎊。

以下載列富時 100 ETF<sup>(a)</sup> 的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以英鎊計值) (截至十二月三十一日)	年初至今	自成立以來
富時 100 指數 <sup>(c)</sup>	14.63% <sup>(f)</sup>	14.63% <sup>(f)</sup>
富時 100 ETF 資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	14.46% <sup>(f)</sup>	14.46% <sup>(f)</sup>
富時 100 ETF 市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	5.65% <sup>(g)</sup>	5.65% <sup>(g)</sup>

富時 100 指數為一項英國上市藍籌公司的自由流通市值加權指數。其乃用作計量於倫敦證券交易所(「倫敦證交所」)上市的市值總額(即實行任何可投資比重前)首 100 家英國公司之表現。富時 100 指數由富時國際有限公司(FTSE International Limited, 「富時」)計算及維持。富時 100 指數乃淨總回報指數，意指計算其表現時，以扣減稅項後之股息再投資為基準。

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 成分基金於二零一六年六月二十三日成立，並於二零一六年六月二十九日上市。

(g) 此為自成分基金上市(二零一六年六月二十九日)以來的回報。

資料來源：貝萊德、MSCI Barra 和 WM/路透社

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩富時 100 指數 ETF

( iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金 )

### 基金活動

根據彭博所報數字，富時 100 ETF 於本期間內的每日平均交投量約為 44,479 個單位。截至二零一六年十二月三十一日，富時 100 ETF 包括 4,800,000 個已發行單位。

### 指數活動

富時 100 指數於期間內進行過四次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，富時 100 ETF 持有富時 100 指數所有成分股。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

### 簡介

iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的成分基金 iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF(「納斯達克 100 ETF」)(「成分基金」)於二零一六年六月二十二日推出，並自二零一六年六月二十九日開始以人民幣櫃檯股份代號 82834、美元櫃檯股份代號 9834 及港元櫃檯股份代號 2834 在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)買賣。納斯達克 100 ETF 是根據香港證券及期貨條例(第 571 章)經認可成立的香港單位信託基金。納斯達克 100 ETF 以納斯達克 100 指數為指標指數。納斯達克 100 ETF 的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」)，而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

### 基金表現

納斯達克 100 ETF 目標為提供在末扣除收費及開支前，與納斯達克 100 指數表現(以美元(「美元」)計值)非常接近的投資回報。截至二零一六年十二月三十一日，納斯達克 100 ETF 的每單位交易資產淨值為 1.15 美元，已發行單位為 6,800,000 個，成分基金總規模約為 780 萬美元。

以下載列納斯達克 100 ETF<sup>(a)</sup> 的表現概要。

總回報 <sup>(b)</sup> (以美元計值)(截至十二月三十一日)	年初至今	自成立以來
納斯達克 100 指數 <sup>(c)</sup>	10.91% <sup>(f)</sup>	10.91% <sup>(f)</sup>
納斯達克 100 ETF 資產淨值對資產淨值 <sup>(d)</sup>	10.73% <sup>(f)</sup>	10.73% <sup>(f)</sup>
納斯達克 100 ETF 市場對市場(MKT) <sup>(e)</sup>	14.11% <sup>(g)</sup>	14.11% <sup>(g)</sup>

納斯達克 100 指數為一項經修訂市值加權指數。其包括於納斯達克證券交易所有限公司(「納斯達克」)上市的市值首 100 家美國及國際非金融公司。納斯達克 100 指數由 The NASDAQ OMX Group Inc. 或其聯屬公司計算及維持。納斯達克 100 指數乃淨總回報指數，意指計算其表現時，以扣減稅項後之股息再投資為基準。

(a) 過往表現並非成分基金未來表現的指標。

(b) 總回報指投資者假若把所有股息和分派再投資，就該項投資可以賺取(或虧損)的比率。截至十二月三十一日計算。

(c) 投資者不可直接投資於指數，而指數表現回報亦不反映可減低成本成分基金表現回報的管理費用、交易成本或其他開支。

(d) 成分基金單位按資產淨值發行及贖回。因此，成分基金不會公佈買入價，而成分基金的回報已按資產淨值計算。

(e) 市場回報按歷史收市價計算(即以一般釐定成分基金資產淨值的時間計算)，但不代表閣下於其他時間買賣單位將會收取的回報。

(f) 成分基金於二零一六年六月二十二日成立，並於二零一六年六月二十九日上市。

(g) 此為自成分基金上市(二零一六年六月二十九日)以來的回報。

# 管理人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF

( iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金 )

### 基金活動

根據彭博所報數字，納斯達克 100 ETF 於本期間的每日平均交投量約為 41,877 個單位。截至二零一六年十二月三十一日，納斯達克 100 ETF 包括 6,800,000 個已發行單位。

### 指數活動

納斯達克 100 指數於期間內進行過一次定期檢討。截至二零一六年十二月三十一日，納斯達克 100 ETF 持有納斯達克 100 指數 107 隻成分股中 106 隻成分股。

# 信託人致基金單位持有人報告

## iShares 安碩亞洲信託基金

我們謹此確認，據我們認為，於截至二零一六年十二月三十一日止年度，iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF、iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF、iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF\* (\* 此基金為一隻合成交易所買賣基金)、iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)、iShares 安碩核心 MSCI 亞洲 (日本除外) 指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲 (日本除外) 指數 ETF)、iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF、iShares 安碩滬深 300 A 股指數 ETF\* (\* 此基金為一隻合成交易所買賣基金)、iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF、iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF、iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF、iShares 安碩歐元區 STOXX 50 指數 ETF、iShares 安碩富時 100 指數 ETF 及 iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF (「成分基金」) 的管理人已在所有重大方面根據二零零一年十一月十六日訂立的信託契據 (經修訂) 的規定管理成分基金。

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司

二零一七年四月二十五日

# 管理人及信託人的責任聲明

## iShares安碩亞洲信託基金

### 管理人的責任

根據香港證券及期貨事務監察委員會頒佈的單位信託及互惠基金守則及於二零零一年十一月十六日訂立的信託契據(經修訂)(「信託契據」)的規定, iShares安碩MSCI中國指數ETF、iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF、iShares安碩富時A50中國指數ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)、iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF(前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)、iShares安碩核心MSCI亞洲(日本除外)指數ETF(前稱iShares安碩MSCI亞洲(日本除外)指數ETF)、iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF、iShares安碩滬深300 A股指數ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)、iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF、iShares安碩核心MSCI台灣指數ETF、iShares安碩德國DAX指數ETF、iShares安碩歐元區STOXX 50指數ETF、iShares安碩富時100指數ETF及iShares安碩納斯達克100指數ETF(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)(「成分基金」)的管理人須編製各年度會計期間的財務報表, 而有關財務報表須真實與公平地反映成分基金於各個期間結束時的財政狀況及截至該日止期間內進行的交易。編製該等財務報表時, 管理人須:

- 選擇並貫徹採用適合的會計政策;
- 審慎、合理地作出判斷及估算; 及
- 按持續經營基準編製成分基金的財務報表, 但不宜作出此項假設時可例外。

此外, 管理人亦須遵照信託契據管理成分基金, 並採取合理步驟預防及偵察有關成分基金的欺詐及其他不當行為發生。

iShares安碩亞洲信託基金(「信託基金」)是受其信託契據規管的傘子單位信託基金。截至二零一六年十二月三十一日, 信託基金設有二十一個成分基金, 分別為iShares安碩MSCI中國指數ETF、iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF、iShares安碩富時A50中國指數ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)、iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF(前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)、iShares安碩核心MSCI亞洲(日本除外)指數ETF(前稱iShares安碩MSCI亞洲(日本除外)指數ETF)、iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF、iShares安碩滬深300 A股指數ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)、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)、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)、iShares安碩滬深A股金融指數ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)、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)、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)、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)、iShares安碩人民幣債券指數ETF、iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF、iShares安碩核心MSCI台灣指數ETF、iShares安碩德國DAX指數ETF、iShares安碩歐元區STOXX 50指數ETF、iShares安碩富時100指數ETF、iShares安碩納斯達克100指數ETF及iShares安碩核心恒生指數ETF。有關iShares安碩核心恒生指數ETF的財務資料並無於本年度報告中載列, 但將於二零一七年的中期報告中載列。有關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)、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)、iShares安碩滬深A股金融指數ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)、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)、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)、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)及iShares安碩人民幣債券指數ETF(「終止成分基金」)的財務資料並無於本年度報告中載列, 但將與終止成分基金的終止審計合併, 覆蓋二零一六年一月一日至終止日的期間。

# 管理人及信託人的責任聲明

## iShares 安碩亞洲信託基金

### 信託人的責任

成分基金的信託人須：

- 確保成分基金在所有重大方面均根據信託契據進行管理，且遵行有關投資及借貸的權力；
- 確保保留有足夠的會計及其他記錄；
- 保護成分基金的財產及其附帶權利；及
- 於每個年度會計期間向基金單位持有人作出報告，倘管理人未根據信託契據管理成分基金。

# 獨立核數師報告

## 致 iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的基金單位持有人

### 財務報表之審計報告

#### 意見

本核數師(以下簡稱「我們」)已審計的內容

載於第 42 至 157 頁 iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF、iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF\*( \* 此基金為一隻合成交易所買賣基金)、iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF(前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)、iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)、iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF 及 iShares 安碩滬深 300 A 股指數 ETF\*( \* 此基金為一隻合成交易所買賣基金)截至二零一六年十二月三十一日止年度、iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF 於二零一六年一月二十五日(成立日期)起至二零一六年十二月三十一日止期間、iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF、iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF 及 iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF 於二零一六年六月二十二日(成立日期)起至二零一六年十二月三十一日止期間以及 iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF、iShares 安碩歐元區 STOXX50 指數 ETF 及 iShares 安碩富時 100 指數 ETF 於二零一六年六月二十三日(成立日期)起至二零一六年十二月三十一日止期間及截至二零一六年十二月三十一日(「有關期間」)(各基金均為信託基金的獨立成分基金,並個別或統稱為「成分基金」)的財務報表,此財務報表包括:

- 截至二零一六年十二月三十一日的財務狀況報表;
- 截至該日止有關期間的全面收入報表;
- 截至該日止有關期間的基金單位持有人應佔資產淨值變動報表;
- 截至該日止有關期間的現金流量報表;及
- 財務報表附註,其包括主要會計政策概要。

#### 我們的意見

我們認為,該等財務報表已根據國際財務報告準則(「國際財務準則」)真實而公平地反映各成分基金截至二零一六年十二月三十一日的財務狀況,及截至該日止有關期間各自的財務交易及現金流量。

#### 意見的基礎

我們已根據國際審計準則(「國際審計準則」)進行審計。我們就該等準則承擔的責任在本報告的「核數師就審計財務報表須承擔的責任」部分中進一步闡述。

我們相信,我們所獲得的審計憑證能充足和適當地為我們的審計意見提供基礎。

#### 獨立性

根據國際會計師專業操守理事會頒佈的專業會計師道德守則(「國際會計師專業操守理事會守則」),我們獨立於成分基金,並已履行國際會計師專業操守理事會守則中的其他專業道德責任。

# 獨立核數師報告

## 致 iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的基金單位持有人(續)

### 關鍵審計事項

關鍵審計事項是根據我們的專業判斷，認為對本期間財務報表的審計最為重要的事項。這些事項是在我們審計整體財務報表及出具意見時進行處理的。我們不會對這些事項提供單獨的意見。

在我們的審計中識別的關鍵審計事項概述如下：

- 投資的存在及估值

關鍵審計事項	我們的審計如何處理關鍵審計事項												
<p>投資的存在及估值</p> <p>各成分基金截至二零一六年十二月三十一日持有的投資主要包括(i)上市股本、(ii)中國A股連接產品(「CAAP」)(定義見財務報表附註1)及(iii)投資基金，於各成分基金相關財務報表中，投資按以下各項進行估值：</p>	<p>我們通過向成分基金的託管人及CAAP發行人(如適用)取得直接確認，測試投資的存在，並認可成分基金於該等確認中的投資持有量。我們於測試中並無發現任何重大異常情況。</p> <p>就各成分基金持有的上市股本而言，我們通過比較成分基金使用的定價與截至二零一六年十二月三十一日的外部定價來源進行估值。我們於測試中並無發現任何重大異常情況。</p> <p>就CAAP而言，我們抽樣核實CAAP的合約條款，確保CAAP均與相關上市股本的表現掛鉤。我們亦為所有CAAP發行人進行信貸息差分析，以評估信貸及交易對手風險對CAAP公平價值(如有)的影響。此外，我們通過比較成分基金使用的定價與截至二零一六年十二月三十一日的外部定價來源對CAAP的相關上市股本進行估值。我們於測試中並無發現任何重大異常情況。</p> <p>就投資基金而言，我們比較其資產淨值所用定價與投資基金管理人所呈報者，以協定其估值。</p>												
<table border="1"><tr><td>iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF</td><td>上市股本： 1,404,195,931 港元</td></tr><tr><td>iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF</td><td>上市股本： 人民幣 65,803,015 元</td></tr><tr><td>iShares 安碩 富時 A50 中國指數 ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)</td><td>上市股本： 14,398,009,383 港元  CAAP： 14,331,170,538 港元</td></tr><tr><td>iShares 安碩 核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩 標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)</td><td>投資基金： 797,797,824 港元</td></tr><tr><td>iShares 安碩 核心 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF)</td><td>上市股本： 4,201,493,392 港元</td></tr><tr><td>iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF</td><td>上市股本： 118,633,229 港元</td></tr></table>	iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF	上市股本： 1,404,195,931 港元	iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF	上市股本： 人民幣 65,803,015 元	iShares 安碩 富時 A50 中國指數 ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)	上市股本： 14,398,009,383 港元  CAAP： 14,331,170,538 港元	iShares 安碩 核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩 標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)	投資基金： 797,797,824 港元	iShares 安碩 核心 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF)	上市股本： 4,201,493,392 港元	iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF	上市股本： 118,633,229 港元	
iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF	上市股本： 1,404,195,931 港元												
iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF	上市股本： 人民幣 65,803,015 元												
iShares 安碩 富時 A50 中國指數 ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)	上市股本： 14,398,009,383 港元  CAAP： 14,331,170,538 港元												
iShares 安碩 核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩 標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)	投資基金： 797,797,824 港元												
iShares 安碩 核心 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF)	上市股本： 4,201,493,392 港元												
iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF	上市股本： 118,633,229 港元												

## 致 iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的基金單位持有人(續)

關鍵審計事項	我們的審計如何處理關鍵審計事項
iShares 安碩滬深 300 A 股指數 ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)	上市股本： 49,299,666 港元  CAAP： 143,161,693 港元
iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF	上市股本： 13,310,016 美元
iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF	上市股本： 19,767,905 美元
iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF	上市股本： 6,063,264 歐元
iShares 安碩歐元區 STOXX 50 指數 ETF	上市股本： 5,078,529 歐元
iShares 安碩富時 100 指數 ETF	上市股本： 3,963,341 英鎊
iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF	上市股本： 7,822,780 美元
若干成分基金持有的投資包括上市股本及截至二零一六年十二月三十一日已暫停買賣相關上市股本的 CAAP，按以下各項進行估值：	
iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF	上市股本： 人民幣 2,962,236 元
iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)	上市股本： 132,100,137 港元  CAAP： 151,232,175 港元
iShares 安碩滬深 300 A 股指數 ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)	上市股本： 1,156,775 港元  CAAP： 3,671,075 港元
iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF	上市股本： 51,922 美元

此外，就上市股本及截至二零一六年十二月三十一日已暫停買賣相關上市股本的 CAAP 而言，我們已評估管理人採納的估值方法的適當性。我們亦透過考慮可能影響其公平價值的因素，包括暫停時間、已暫停上市股本及已暫停相關上市股本的 CAAP 的相關市場資料及訊息、暫停期間可資比較指數的價格變動情況以及(如適用)已暫停上市股本及已暫停相關上市股本的 CAAP 於二零一六年十二月三十一日後恢復買賣的市場價格，評估於釐定該等投資估值時所作出的判斷。

根據我們所執行的審計程序，我們認為，現有憑證可支持就釐定投資估值所作出的判斷。

# 獨立核數師報告

## 致 iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的基金單位持有人(續)

關鍵審計事項	我們的審計如何處理關鍵審計事項
<p>由於有關投資佔各成分基金資產淨值的主要部分，故我們專注於投資的存在及估值。此外，我們亦專注於上市股本及截至二零一六年十二月三十一日已暫停買賣相關上市股本的 CAAP 的估值，原因是管理人於釐定上述各項的公平價值時作出的判斷涉及高度主觀性。</p> <p>請參閱財務報表附註 11。</p>	

### 其他信息

成分基金管理人及信託人(「管理層」)須對其他信息負責。其他信息包括年報內的所有信息，但不包括財務報表及我們的核數師報告。

我們對成分基金財務報表的意見並不涵蓋其他信息，我們亦不對該等其他信息發表任何形式的鑒證結論。

結合我們對財務報表的審計，我們的責任是閱讀其他信息，在此過程中，考慮其他信息是否與財務報表或我們在審計過程中所了解的情況存在重大抵觸或者似乎存在重大錯誤陳述的情況。

基於我們已執行的工作，如果我們認為其他信息存在重大錯誤陳述，我們需要報告該事實。在這方面，我們沒有任何報告。

### 管理層就財務報表須承擔的責任

成分基金管理層負責根據國際財務準則擬備真實而中肯的財務報表，並對其認為為使財務報表的擬備不存在由於欺詐或錯誤而導致的重大錯誤陳述所需的內部控制負責。

在擬備財務報表時，成分基金管理層負責評估成分基金持續經營的能力，並在適用情況下披露與持續經營有關的事項，以及使用持續經營為會計基礎，除非管理層有意將成分基金清盤或停止經營，或別無其他實際的替代方案。

此外，成分基金管理層須確保財務報表已根據日期為二零零一年十一月十六日的信託契據(經修訂)(「信託契據」)的相關條文及香港證券及期貨事務監察委員會頒佈的單位信託及互惠基金守則(「證監會守則」)附錄 E 的相關披露規定妥為擬備。

# 獨立核數師報告

## 致 iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的基金單位持有人(續)

### 核數師就審計財務報表須承擔的責任

我們的目標，是對財務報表整體是否不存在由於欺詐或錯誤而導致的重大錯誤陳述取得合理保證，並出具包括我們意見的核數師報告。我們僅向閣下(作為整體)報告，除此之外本報告別無其他目的。我們不會就本報告的內容向任何其他人士負上或承擔任何責任。合理保證是高水平的保證，但不能保證按照國際審計準則進行的審計，總能發現存在的重大錯誤陳述。錯誤陳述可以由欺詐或錯誤引起，如果合理預期它們單獨或匯總起來可能影響財務報表使用者依賴財務報表所作出的經濟決定，則有關的錯誤陳述可被視作重大。此外，我們須評估成分基金財務報表是否已於所有重大方面根據信託契據的相關條文及證監會守則附錄E的相關披露規定妥為擬備。

在根據國際審計準則進行審計的過程中，我們運用了專業判斷，保持了專業懷疑態度。我們亦：

- 識別和評估由於欺詐或錯誤而導致財務報表存在重大錯誤陳述的風險，設計及執行審計程序以應對這些風險，以及獲取充足和適當的審計憑證，作為我們意見的基礎。由於欺詐可能涉及串謀、偽造、蓄意遺漏、虛假陳述，或凌駕於內部控制之上，因此未能發現因欺詐而導致的重大錯誤陳述的風險高於未能發現因錯誤而導致的重大錯誤陳述的風險。
- 了解與審計相關的內部控制，以設計適當的審計程序，但目的並非對成分基金內部控制的有效性發表意見。
- 評價管理層所採用會計政策的恰當性及作出會計估計和相關披露的合理性。
- 對管理層採用持續經營會計基礎的恰當性作出結論。根據所獲取的審計憑證，確定是否存在與事項或情況有關的重大不確定性，從而可能導致對成分基金的持續經營能力產生重大疑慮。如果我們認為存在重大不確定性，則有必要在核數師報告中提請使用者注意財務報表中的相關披露。假若有關的披露不足，則我們應當發表非無保留意見。我們的結論是基於核數師報告日止所取得的審計憑證。然而，未來事項或情況可能導致成分基金不能持續經營。
- 評價財務報表的整體列報方式、結構和內容，包括披露，以及財務報表是否中肯反映相關交易和事項。

除其他事項外，我們與管理層溝通了計劃的審計範圍、時間安排、重大審計發現等，包括我們在審計中識別出內部控制的任何重大缺陷。

# 獨立核數師報告

## 致 iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)的基金單位持有人(續)

我們還向管理層提交聲明，說明我們已符合有關獨立性的相關專業道德要求，並與他們溝通有可能合理地被認為會影響我們獨立性的所有關係和其他事項，以及在適用的情況下，相關的防範措施。

從與管理層溝通的事項中，我們確定哪些事項對本期財務報表的審計最為重要，因而構成關鍵審計事項。我們在核數師報告中描述這些事項，除非法律法規不允許公開披露這些事項，或在極端罕見的情況下，如果合理預期在我們報告中溝通某事項造成的負面後果超過產生的公眾利益，我們決定不應在報告中溝通該事項。

### 有關信託契據的相關條文及證監會守則附錄 E 的相關披露規定所涉事項的報告

我們認為，成分基金財務報表已於所有重大方面按照信託契據的相關條文及證監會守則附錄 E 的相關披露規定妥為擬備。

出具本獨立核數師報告的審計項目合夥人是 Tsui, Maria Yuk Hung。

**羅兵咸永道會計師事務所**

執業會計師

香港，二零一七年四月二十五日

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務狀況報表

於二零一六年十二月三十一日

	附註	iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF		iShares 安碩 MSCI 中國 A 股 國際指數 ETF
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 人民幣
<b>資產</b>				
<b>流動資產</b>				
按公平價值透過損益記賬的金融資產	11(a)	1,404,268,081	2,408,690,764	65,803,015
應收股息		53,207	34,985	-
應收利息		1	-	-
應收經紀商款項	11(b)	4,819,002	-	-
應收管理費用	7(a)	-	-	32,079
其他應收賬款		2,104	-	-
保證金存款	11(b)	175,847	152,400	-
銀行結存	7(e), 11(b)	5,114,433	4,771,207	248,920
<b>總資產</b>		<b>1,414,432,675</b>	<b>2,413,649,356</b>	<b>66,084,014</b>
<b>負債</b>				
<b>流動負債</b>				
按公平價值透過損益記賬的金融負債	11(a)	-	44,400	-
應付基金單位持有人贖回款項		4,821,127	-	-
應付管理費用	7(a)	705,736	1,182,569	-
抵押安排應付借出證券費用		-	-	-
其他應付賬款		30,722	68,435	11,876
<b>總負債</b>		<b>5,557,585</b>	<b>1,295,404</b>	<b>11,876</b>
<b>基金單位持有人應佔資產淨值</b>		<b>1,408,875,090</b>	<b>2,412,353,952</b>	<b>66,072,138</b>

經信託人及管理人於二零一七年四月二十五日批准。

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司為信託基金的信託人。

貝萊德資產管理北亞有限公司為信託基金的管理人。

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務狀況報表(續)

於二零一六年十二月三十一日

	附註	iShares 安碩 富時 A50 中國指數 ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)		iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩 標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)	
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>資產</b>					
<b>流動資產</b>					
按公平價值透過損益記賬的金融資產	11(a)	28,729,179,921	42,722,659,436	797,797,824	826,151,554
應收股息		-	1,018,736	-	-
應收利息		158	185	1	1
其他應收賬款		-	16,277	-	-
銀行結存	7(e), 11(b)	134,370,833	811,998,310	2,113,901	2,529,443
<b>總資產</b>		<b>28,863,550,912</b>	<b>43,535,692,944</b>	<b>799,911,726</b>	<b>828,680,998</b>
<b>負債</b>					
<b>流動負債</b>					
應付管理費用	7(a)	24,440,101	35,241,981	309,608	567,542
抵押安排應付借出證券費用		25,516,273	62,252,623	-	-
其他應付賬款		215,345	477,842,937	-	15,000
<b>總負債</b>		<b>50,171,719</b>	<b>575,337,541</b>	<b>309,608</b>	<b>582,542</b>
<b>基金單位持有人應佔資產淨值</b>		<b>28,813,379,193</b>	<b>42,960,355,403</b>	<b>799,602,118</b>	<b>828,098,456</b>

經信託人及管理人於二零一七年四月二十五日批准。

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司為信託基金的信託人。

貝萊德資產管理北亞有限公司為信託基金的管理人。

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務狀況報表(續)

於二零一六年十二月三十一日

	附註	iShares 安碩核心 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)		iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF	
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>資產</b>					
<b>流動資產</b>					
按公平價值透過損益記賬的金融資產	11(a)	4,201,493,393	91,833,618	118,633,229	121,965,009
應收股息		689,969	31,783	9,533	24,631
應收利息		3	-	-	-
應收經紀商款項	11(b)	-	72,682	-	-
銀行結存	7(e), 11(b)	10,430,214	108,995	667,971	621,631
<b>總資產</b>		<b>4,212,613,579</b>	<b>92,047,078</b>	<b>119,310,733</b>	<b>122,611,271</b>
<b>負債</b>					
<b>流動負債</b>					
應付管理費用	7(a)	479,360	39,805	54,690	46,110
其他應付賬款		41,746	37,553	7,443	40,734
<b>總負債</b>		<b>521,106</b>	<b>77,358</b>	<b>62,133</b>	<b>86,844</b>
<b>基金單位持有人應佔資產淨值</b>		<b>4,212,092,473</b>	<b>91,969,720</b>	<b>119,248,600</b>	<b>122,524,427</b>

經信託人及管理人於二零一七年四月二十五日批准。

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司為信託基金的信託人。

貝萊德資產管理北亞有限公司為信託基金的管理人。

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務狀況報表(續)

於二零一六年十二月三十一日

	附註	iShares 安碩滬深300 A股 指數ETF*( *此基金為一隻合成 交易所買賣基金)		iShares 安碩 核心韓國綜合股價 200指數ETF	iShares 安碩 核心 MSCI 台灣 指數ETF
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 美元	二零一六年 美元
<b>資產</b>					
<b>流動資產</b>					
按公平價值透過損益記賬的金融資產	11(a)	192,461,359	292,323,312	13,310,016	19,767,905
應收股息		3,202	1,096	157,539	-
應收利息		2	-	-	-
銀行結存	7(e), 11(b)	1,925,593	2,565,721	20,887	78,395
<b>總資產</b>		<b>194,390,156</b>	<b>294,890,129</b>	<b>13,488,442</b>	<b>19,846,300</b>
<b>負債</b>					
<b>流動負債</b>					
應付經紀商款項		-	297,192	-	-
應付基金單位持有人贖回款項		-	91,408	-	-
應付管理費用	7(a)	168,513	248,572	3,815	4,741
抵押安排應付借出證券費用		433,645	773,671	-	-
其他應付賬款		94,864	981,211	2,210	2,115
<b>總負債</b>		<b>697,022</b>	<b>2,392,054</b>	<b>6,025</b>	<b>6,856</b>
<b>基金單位持有人應佔資產淨值</b>		<b>193,693,134</b>	<b>292,498,075</b>	<b>13,482,417</b>	<b>19,839,444</b>

經信託人及管理人於二零一七年四月二十五日批准。

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司為信託基金的信託人。

貝萊德資產管理北亞有限公司為信託基金的管理人。

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務狀況報表(續)

於二零一六年十二月三十一日

	附註	iShares 安碩 德國 DAX 指數 ETF	iShares 安碩 歐元區 STOXX 50 指數 ETF	iShares 安碩 富時 100 指數 ETF	iShares 安碩納斯 達克 100 指數 ETF
		二零一六年 歐元	二零一六年 歐元	二零一六年 英鎊	二零一六年 美元
<b>資產</b>					
<b>流動資產</b>					
按公平價值透過損益記賬的金融資產	11(a)	6,063,264	5,078,529	3,963,654	7,822,780
應收股息		-	2,878	14,545	2,730
銀行結存	7(e), 11(b)	16,906	27,172	14,809	29,686
<b>總資產</b>		<b>6,080,170</b>	<b>5,108,579</b>	<b>3,993,008</b>	<b>7,855,196</b>
<b>負債</b>					
<b>流動負債</b>					
應付管理費用	7(a)	1,763	1,674	1,362	2,927
其他應付賬款		5,889	6,065	2,944	6,400
<b>總負債</b>		<b>7,652</b>	<b>7,739</b>	<b>4,306</b>	<b>9,327</b>
<b>基金單位持有人應佔資產淨值</b>		<b>6,072,518</b>	<b>5,100,840</b>	<b>3,988,702</b>	<b>7,845,869</b>

經信託人及管理人於二零一七年四月二十五日批准。

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司為信託基金的信託人。

貝萊德資產管理北亞有限公司為信託基金的管理人。

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 全面收入報表

截至二零一六年十二月三十一日止年度／期間

	附註	iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF		iShares 安碩 MSCI 中國 A 股 國際指數 ETF
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 一月二十五日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 人民幣
<b>收入</b>				
股息收入		47,237,282	118,288,536	2,352,053
銀行利息收入	7(e)	693	40	3,473
按公平價值透過損益記賬的金融資產淨收益／(虧損)	5	(92,529,832)	(793,294,496)	6,209,879
外幣淨虧損		(87,927)	(10,331)	(1,431)
總淨收入／(虧損)		(45,379,784)	(675,016,251)	8,563,974
<b>開支</b>				
管理費用	7(a)	(10,281,726)	(17,785,312)	(580,172)
交易手續費	7(b)	(75,721)	(118,875)	(124,238)
按公平價值透過損益記賬的金融資產交易成本	7(d)	(400,117)	(1,064,987)	(209,333)
託管及銀行費用	7(b)	(270,029)	(948,421)	(221,730)
抵押安排借出證券費用	11(b)	-	-	-
總經營開支		(11,027,593)	(19,917,595)	(1,135,473)
經營溢利／(虧損)		(56,407,377)	(694,933,846)	7,428,501
<b>融資成本</b>				
利息開支	7(f)	-	-	-
除稅前溢利／(虧損)		(56,407,377)	(694,933,846)	7,428,501
稅項	6	(3,757,730)	(9,074,879)	(235,548)
總全面收入／(虧損)		(60,165,107)	(704,008,725)	7,192,953

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 全面收入報表(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)		iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)	
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>收入</b>					
股息收入		938,639,093	1,199,905,854	-	-
銀行利息收入	7(e)	3,710,155	1,028,385	300	243
按公平價值透過損益記賬的金融資產淨收益/ (虧損)	5	(4,325,828,672)	(812,186,257)	4,624,765	(91,566,653)
外幣淨收益/(虧損)		(11,593,007)	(16,197,459)	209	(287)
總淨收入/(虧損)		(3,395,072,431)	372,550,523	4,625,274	(91,566,697)
<b>開支</b>					
管理費用	7(a)	(312,133,492)	(542,486,660)	(5,041,232)	(9,250,113)
交易手續費	7(b)	(1,050,175)	(1,185,290)	-	-
按公平價值透過損益記賬的金融資產交易成本	7(d)	(272,372,295)	(305,753,773)	-	-
託管及銀行費用	7(b)	(81,828)	(4,841,977)	(200)	(200)
抵押安排借出證券費用	11(b)	(369,065,397)	(761,265,739)	-	-
總經營開支		(954,703,187)	(1,615,533,439)	(5,041,432)	(9,250,313)
經營溢利/(虧損)		(4,349,775,618)	(1,242,982,916)	(416,158)	(100,817,010)
<b>融資成本</b>					
利息開支	7(f)	(716)	-	-	-
除稅前虧損		(4,349,776,334)	(1,242,982,916)	(416,158)	(100,817,010)
稅項	6	(93,935,237)	(120,004,668)	-	-
總全面虧損		(4,443,711,571)	(1,362,987,584)	(416,158)	(100,817,010)

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 全面收入報表(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩核心 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF)		iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF	
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>收入</b>					
股息收入		32,695,806	3,688,072	2,925,800	3,924,155
銀行利息收入	7(e)	1,352	79	37	26
按公平價值透過損益記賬的金融資產淨收益/ (虧損)	5	(69,624,796)	(14,342,799)	5,291,258	(19,201,294)
外幣淨收益/(虧損)		4,383,222	(109,878)	(14,975)	(151,189)
總淨收入/(虧損)		(32,544,416)	(10,764,526)	8,202,120	(15,428,302)
<b>開支</b>					
管理費用	7(a)	(3,650,710)	(686,481)	(606,604)	(742,364)
交易手續費	7(b)	(138,093)	(213,504)	(82,108)	(60,464)
按公平價值透過損益記賬的金融資產交易成本	7(d)	(2,236,328)	(304,593)	(46,674)	(84,604)
託管及銀行費用	7(b)	(210,135)	(19,797)	(34,100)	(29,034)
總經營開支		(6,235,266)	(1,224,375)	(769,486)	(916,466)
經營溢利/(虧損)		(38,779,682)	(11,988,901)	7,432,634	(16,344,768)
<b>融資成本</b>					
利息開支	7(f)	-	(110)	(13)	(332)
除稅前溢利/(虧損)		(38,779,682)	(11,989,011)	7,432,621	(16,345,100)
稅項	6	(3,541,857)	(403,254)	(427,046)	(539,474)
總全面收入/(虧損)		(42,321,539)	(12,392,265)	7,005,575	(16,884,574)

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 全面收入報表(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩滬深300 A股 指數ETF*( *此基金為一隻合成 交易所買賣基金)		iShares 安碩核心 韓國綜合股價 200指數ETF	iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元
<b>收入</b>					
股息收入		4,431,522	6,200,922	216,243	719,513
銀行利息收入	7(e)	17,752	5,448	10	31
按公平價值透過損益記賬的金融資產淨收益/ (虧損)	5	(43,937,900)	30,715,166	143,399	1,224,339
外幣淨收益/(虧損)		87,856	(10,140)	2,098	(5,064)
總淨收入/(虧損)		(39,400,770)	36,911,396	361,750	1,938,819
<b>開支</b>					
管理費用	7(a)	(2,108,655)	(3,680,437)	(26,479)	(33,642)
交易手續費	7(b)	(275,322)	(462,174)	(1,740)	(4,725)
按公平價值透過損益記賬的金融資產交易成本	7(d)	(1,810,416)	(1,015,509)	(26,272)	(32,932)
託管及銀行費用	7(b)	(5,682)	(4,300)	(205)	(542)
抵押安排借出證券費用	11(b)	(3,740,204)	(6,283,098)	-	-
總經營開支		(7,940,279)	(11,445,518)	(54,696)	(71,841)
經營溢利/(虧損)		(47,341,049)	25,465,878	307,054	1,866,978
<b>融資成本</b>					
利息開支	7(f)	(13,768)	(32)	-	-
除稅前溢利/(虧損)		(47,354,817)	25,465,846	307,054	1,866,978
稅項	6	(443,275)	(620,092)	(48,562)	(162,286)
總全面收入/(虧損)		(47,798,092)	24,845,754	258,492	1,704,692

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 全面收入報表(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩德國 DAX 指數ETF	iShares 安碩 歐元區 STOXX 50 指數ETF	iShares 安碩富時 100 指數ETF	iShares 安碩 納斯達克 100 指數ETF
		二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 歐元	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 歐元	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 英鎊	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元
<b>收入</b>					
股息收入		3,717	44,279	117,535	86,472
銀行利息收入	7(e)	-	-	3	13
按公平價值透過損益記賬的金融資產淨收益	5	929,683	634,116	726,747	1,388,470
外幣淨虧損		(82)	(135)	(646)	-
<b>總淨收入</b>		<b>933,318</b>	<b>678,260</b>	<b>843,639</b>	<b>1,474,955</b>
<b>開支</b>					
管理費用	7(a)	(8,420)	(8,127)	(6,825)	(19,383)
交易手續費	7(b)	(371)	(3,099)	(2,064)	(1,025)
按公平價值透過損益記賬的金融資產交易成本	7(d)	(1,295)	(9,002)	(32,535)	(3,276)
託管及銀行費用	7(b)	-	(190)	-	(1)
<b>總經營開支</b>		<b>(10,086)</b>	<b>(20,418)</b>	<b>(41,424)</b>	<b>(23,685)</b>
<b>經營溢利/(虧損)</b>		<b>923,232</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>融資成本</b>					
利息開支	7(f)	-	-	-	-
<b>除稅前溢利</b>		<b>923,232</b>	<b>657,842</b>	<b>802,215</b>	<b>1,451,270</b>
稅項	6	(980)	(10,372)	(625)	(25,214)
<b>總全面收入</b>		<b>922,252</b>	<b>647,470</b>	<b>801,590</b>	<b>1,426,056</b>

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 基金單位持有人應佔資產淨值變動報表

截至二零一六年十二月三十一日止年度／期間

	附註	iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF		iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 一月二十五日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 人民幣
於一月一日／成立日期基金單位持有人應佔資產淨值		2,412,353,952	1,267,054,099	-
發行單位所得款項	8			
- 以實物方式		225,900,392	3,824,197,272	-
- 現金成分及現金認購		52,001,570	108,229,586	116,850,655
贖回單位所付款項	8			
- 以實物方式		(958,315,577)	(1,962,344,170)	-
- 現金成分及現金贖回		(227,296,140)	(34,248,110)	(56,711,470)
向基金單位持有人作出的分派	12	(35,604,000)	(86,526,000)	(1,260,000)
		(943,313,755)	1,849,308,578	58,879,185
本年度／期間總全面收入／(虧損)		(60,165,107)	(704,008,725)	7,192,953
於十二月三十一日基金單位持有人應佔資產淨值		1,408,875,090	2,412,353,952	66,072,138

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 基金單位持有人應佔資產淨值變動報表 (續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)		iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)	
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
於一月一日/成立日期基金單位持有人應佔資產淨值		42,960,355,403	88,566,779,452	828,098,456	1,340,170,506
發行單位所得款項	8				
– 以實物方式		272,014,773	7,514,824,497	-	-
– 現金成分及現金認購		1,597,627	4,100,912,471	14,000,400	51,760,800
贖回單位所付款項	8				
– 以實物方式		(6,543,468,490)	(44,929,916,659)	-	-
– 現金成分及現金贖回		(2,637,208,549)	(9,909,856,774)	(42,080,580)	(463,015,840)
向基金單位持有人作出的分派	12	(796,200,000)	(1,019,400,000)	-	-
		(9,703,264,639)	(44,243,436,465)	(28,080,180)	(411,255,040)
本年度/期間總全面收入/(虧損)		(4,443,711,571)	(1,362,987,584)	(416,158)	(100,817,010)
於十二月三十一日基金單位持有人應佔資產淨值		28,813,379,193	42,960,355,403	799,602,118	828,098,456

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 基金單位持有人應佔資產淨值變動報表 (續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度／期間

	附註	iShares 安碩核心 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF)		iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF	
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
於一月一日基金單位持有人 應佔資產淨值		91,969,720	102,094,387	122,524,427	158,280,131
發行單位所得款項	8				
– 以實物方式		801,720,298	65,721,077	-	-
– 現金成分及現金認購		3,409,472,093	2,388,343	-	-
贖回單位所付款項	8				
– 以實物方式		-	-	(961,386)	(918,476)
– 現金成分及現金贖回		(20,344,099)	(64,041,822)	(7,220,016)	(14,880,654)
向基金單位持有人作出的分派	12	(28,404,000)	(1,800,000)	(2,100,000)	(3,072,000)
		4,162,444,292	2,267,598	(10,281,402)	(18,871,130)
本年度總全面收入／(虧損)		(42,321,539)	(12,392,265)	7,005,575	(16,884,574)
於十二月三十一日基金單位持有人應佔資產淨值		4,212,092,473	91,969,720	119,248,600	122,524,427

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 基金單位持有人應佔資產淨值變動報表 (續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩滬深300 A股 指數ETF*( *此基金為一隻合成 交易所買賣基金)		iShares 安碩 核心韓國綜合股價 200 指數ETF	iShares 安碩 核心 MSCI 台灣指數ETF
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元
於一月一日/成立日期基金單位持有人 應佔資產淨值		292,498,075	384,645,991	-	-
發行單位所得款項	8				
— 現金成分及現金認購		-	-	19,831,326	26,222,371
贖回單位所付款項	8				
— 現金成分及現金贖回		(47,486,849)	(112,593,670)	(6,607,401)	(7,735,619)
向基金單位持有人作出的分派	12	(3,520,000)	(4,400,000)	-	(352,000)
		(51,006,849)	(116,993,670)	13,223,925	18,134,752
本年度/期間總全面收入/(虧損)		(47,798,092)	24,845,754	258,492	1,704,692
於十二月三十一日基金單位持有人應佔資產淨值		193,693,134	292,498,075	13,482,417	19,839,444

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 基金單位持有人應佔資產淨值變動報表 (續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF	iShares 安碩 歐元區 STOXX 50 指數 ETF	iShares 安碩富時 100 指數 ETF	iShares 安碩 納斯達克 100 指數 ETF
		二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 歐元	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 歐元	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 英鎊	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元
於成立日期基金單位持有人 應佔資產淨值		-	-	-	-
發行單位所得款項	8				
— 現金成分及現金認購		8,052,917	8,071,935	6,273,459	12,922,638
贖回單位所付款項	8				
— 現金成分及現金贖回		(2,902,651)	(3,618,565)	(3,086,347)	(6,502,825)
		5,150,266	4,453,370	3,187,112	6,419,813
本期間總全面收入		922,252	647,470	801,590	1,426,056
於十二月三十一日基金單位持有人應佔資產淨值		6,072,518	5,100,840	3,988,702	7,845,869

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 現金流量報表

截至二零一六年十二月三十一日止年度／期間

	附註	iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF		iShares 安碩 MSCI 中國 A 股 國際指數 ETF
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 一月二十五日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 人民幣
<b>經營活動</b>				
購買按公平價值透過損益記賬的金融資產付款		(354,268,669)	(724,390,051)	(133,558,996)
出售按公平價值透過損益記賬的金融資產所得款項		528,795,006	649,735,031	73,964,429
已收股息		47,219,060	118,383,491	2,352,053
已收銀行利息		692	40	3,473
已付管理費用		(10,758,559)	(18,118,985)	(612,251)
已付稅項		(3,757,730)	(9,074,879)	(235,548)
已付交易成本		(400,117)	(1,064,987)	(209,333)
抵押安排已付借出證券費用		-	-	-
其他已付費用		(385,567)	(1,005,920)	(334,092)
已付保證金存款		(23,447)	(152,400)	-
經營活動產生／(所用)的淨現金		206,420,669	14,311,340	(58,630,265)
<b>融資活動</b>				
已付利息		-	-	-
發行單位收取的現金成分及現金認購	8	52,001,570	108,229,586	116,850,655
贖回單位所付的現金成分及現金贖回	8	(222,475,013)	(34,248,110)	(56,711,470)
已付末期分派	12	(35,604,000)	(86,526,000)	(1,260,000)
融資活動產生／(所用)的淨現金		(206,077,443)	(12,544,524)	58,879,185
現金及現金等價物增加淨額		343,226	1,766,816	248,920
年初／期初的現金及現金等價物		4,771,207	3,004,391	-
年終／期終的現金及現金等價物		5,114,433	4,771,207	248,920
<b>現金及現金等價物結餘分析</b>				
銀行結存		5,114,433	4,771,207	248,920

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 現金流量報表 (續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)		iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)	
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>經營活動</b>					
購買按公平價值透過損益記賬的金融資產付款		(16,719,849,405)	(32,806,889,251)	(13,958,913)	(51,652,672)
出售按公平價值透過損益記賬的金融資產 所得款項		19,732,855,115	39,730,380,564	46,937,617	473,378,820
已收股息		939,657,829	1,198,887,118	-	-
已收銀行利息		3,710,182	1,030,258	300	243
已付管理費用		(322,935,372)	(633,079,018)	(5,299,166)	(10,917,078)
已付稅項		(93,935,237)	(120,004,850)	-	-
已付交易成本		(272,372,295)	(305,753,773)	-	-
抵押安排已付借出證券費用		(405,801,747)	(836,814,359)	-	-
其他已付費用		(107,144,909)	(3,666,427)	(15,200)	(15,200)
<b>經營活動產生的淨現金</b>		<b>2,754,184,161</b>	<b>6,224,090,262</b>	<b>27,664,638</b>	<b>410,794,113</b>
<b>融資活動</b>					
已付利息		(716)	-	-	-
發行單位收取的現金成分及現金認購	8	1,597,627	4,100,912,471	14,000,400	51,760,800
贖回單位所付的現金成分及現金贖回	8	(2,637,208,549)	(9,911,471,644)	(42,080,580)	(463,015,840)
已付末期分派	12	(796,200,000)	(1,019,400,000)	-	-
<b>融資活動產生/(所用)的淨現金</b>		<b>(3,431,811,638)</b>	<b>(6,829,959,173)</b>	<b>(28,080,180)</b>	<b>(411,255,040)</b>
<b>現金及現金等價物減少淨額</b>		<b>(677,627,477)</b>	<b>(605,868,911)</b>	<b>(415,542)</b>	<b>(460,927)</b>
年初的現金及現金等價物		811,998,310	1,417,867,221	2,529,443	2,990,370
年終的現金及現金等價物		134,370,833	811,998,310	2,113,901	2,529,443
<b>現金及現金等價物結餘分析</b>					
銀行結存		134,370,833	811,998,310	2,113,901	2,529,443

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 現金流量報表 (續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩核心 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲 (日本除外)指數 ETF)		iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF	
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>經營活動</b>					
購買按公平價值透過損益記賬的金融資產付款		(3,574,046,100)	(80,237,085)	(13,229,711)	(20,733,837)
出售按公平價值透過損益記賬的金融資產 所得款項		200,937,731	141,583,537	20,876,388	36,129,080
已收股息		32,037,620	3,686,805	2,940,898	3,965,978
已收銀行利息		1,349	79	37	26
已付管理費用		(3,211,155)	(965,492)	(598,024)	(1,043,603)
已付稅項		(3,541,857)	(403,254)	(427,046)	(539,474)
已付交易成本		(2,236,328)	(304,593)	(46,674)	(84,604)
其他已付費用		(344,035)	(205,250)	(149,499)	(70,860)
經營活動產生/(所用)的淨現金		(3,350,402,775)	63,154,747	9,366,369	17,622,706
<b>融資活動</b>					
已付利息		-	(110)	(13)	(332)
發行單位收取的現金成分及現金認購	8	3,409,472,093	2,388,343	-	-
贖回單位所付的現金成分及現金贖回	8	(20,344,099)	(64,041,822)	(7,220,016)	(14,880,654)
已付末期分派	12	(28,404,000)	(1,800,000)	(2,100,000)	(3,072,000)
融資活動產生/(所用)的淨現金		3,360,723,994	(63,453,589)	(9,320,029)	(17,952,986)
現金及現金等價物增加/(減少)淨額		10,321,219	(298,842)	46,340	(330,280)
年初的現金及現金等價物		108,995	407,837	621,631	951,911
年終的現金及現金等價物		10,430,214	108,995	667,971	621,631
<b>現金及現金等價物結餘分析</b>					
銀行結存		10,430,214	108,995	667,971	621,631

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 現金流量報表 (續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩滬深300 A股 指數ETF*( *此基金為一隻合成 交易所買賣基金)		iShares 安碩 核心韓國綜合股價 200指數ETF	iShares 安碩 核心MSCI 台灣指數ETF
		二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元
<b>經營活動</b>					
購買按公平價值透過損益記賬的金融資產付款		(82,844,883)	(203,325,771)	(19,934,139)	(27,455,328)
出售按公平價值透過損益記賬的金融資產 所得款項		137,633,578	325,967,186	6,769,620	8,906,698
已收股息		4,429,416	6,211,408	58,704	719,513
已收銀行利息		17,750	5,452	10	31
已付管理費用		(2,188,714)	(4,250,769)	(22,664)	(28,901)
已付稅項		(443,275)	(620,092)	(48,562)	(162,286)
已付交易成本		(1,810,416)	(1,015,509)	(26,272)	(32,932)
抵押安排已付借出證券費用		(4,080,230)	(6,069,468)	-	-
其他退回/(已付)費用		(241,329)	(474,580)	265	(3,152)
經營活動產生/(所用)的淨現金		50,471,897	116,427,857	(13,203,038)	(18,056,357)
<b>融資活動</b>					
已付利息		(13,768)	(32)	-	-
發行單位收取的現金成分及現金認購	8	-	-	19,831,326	26,222,371
贖回單位所付的現金成分及現金贖回	8	(47,578,257)	(112,502,262)	(6,607,401)	(7,735,619)
已付末期分派	12	(3,520,000)	(4,400,000)	-	(352,000)
融資活動產生/(所用)的淨現金		(51,112,025)	(116,902,294)	13,223,925	18,134,752
現金及現金等價物增加/(減少)淨額		(640,128)	(474,437)	20,887	78,395
年初/期初的現金及現金等價物		2,565,721	3,040,158	-	-
年終/期終的現金及現金等價物		1,925,593	2,565,721	20,887	78,395
<b>現金及現金等價物結餘分析</b>					
銀行結存		1,925,593	2,565,721	20,887	78,395

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 現金流量報表 (續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度/期間

	附註	iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF	iShares 安碩 歐元區 STOXX 50 指數 ETF	iShares 安碩富時 100 指數 ETF	iShares 安碩 納斯達克 100 指數 ETF
		二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 歐元	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 歐元	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 英鎊	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元
<b>經營活動</b>					
購買按公平價值透過損益記賬的金融資產付款		(8,442,379)	(8,826,413)	(6,680,771)	(13,149,506)
出售按公平價值透過損益記賬的金融資產 所得款項		3,308,716	4,381,865	3,443,218	6,715,196
已收股息		3,717	41,401	102,990	83,742
已收銀行利息		-	-	3	13
已付管理費用		(6,657)	(6,453)	(5,463)	(16,456)
已付稅項		(980)	(10,372)	(625)	(25,214)
已付交易成本		(1,295)	(9,002)	(32,535)	(3,276)
其他退回費用		5,518	2,776	880	5,374
經營活動產生/(所用)的淨現金		(5,133,360)	(4,426,198)	(3,172,303)	(6,390,127)
<b>融資活動</b>					
發行單位收取的現金成分及現金認購	8	8,052,917	8,071,935	6,273,459	12,922,638
贖回單位所付的現金成分及現金贖回	8	(2,902,651)	(3,618,565)	(3,086,347)	(6,502,825)
融資活動產生的淨現金		5,150,266	4,453,370	3,187,112	6,419,813
現金及現金等價物增加淨額		16,906	27,172	14,809	29,686
期初的現金及現金等價物		-	-	-	-
期終的現金及現金等價物		16,906	27,172	14,809	29,686
<b>現金及現金等價物結餘分析</b>					
銀行結存		16,906	27,172	14,809	29,686

隨附附註為本財務報表的組成部分。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註

### 1 信託基金

iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)是受二零零一年十一月十六日訂立的信託契據(經修訂)(「信託契據」)規管並獲香港證券及期貨事務監察委員會(「證監會」)根據證券及期貨條例第 104(1)條認可的傘子單位信託基金。

截至二零一六年十二月三十一日，信託基金有二十一個已成立的成分基金：

成分基金名稱	於香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)的上市日期
iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF	二零零一年十一月二十八日
iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF	二零一六年一月二十八日
iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)	二零零四年十一月十八日
iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF(前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)	二零零六年十一月二日 (港元櫃檯) 二零一六年十月十四日 (美元及人民幣櫃檯)
iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)	二零零九年四月二十三日 (港元櫃檯) 二零一六年十月十四日 (美元及人民幣櫃檯)
iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF	二零零九年四月二十三日
iShares 安碩滬深 300 A 股指數 ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)	二零零九年十一月十八日
iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF	二零一六年六月二十九日
iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF	二零一六年六月二十九日
iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF	二零一六年六月二十九日
iShares 安碩歐元區 STOXX 50 指數 ETF	二零一六年六月二十九日
iShares 安碩富時 100 指數 ETF	二零一六年六月二十九日
iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF	二零一六年六月二十九日
iShares 安碩核心恒生指數 ETF	二零一六年十一月二十三日
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)	二零零九年十一月十八日
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)	二零零九年十一月十八日
iShares 安碩滬深 A 股金融指數 ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)	二零零九年十一月十八日
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)	二零零九年十一月十八日
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)	二零一零年七月二十日
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)	二零一零年七月二十日
iShares 安碩人民幣債券指數 ETF	二零一三年六月十八日

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

本財務報表乃有關前十三個成分基金(各基金均為信託基金的獨立成分基金,並個別或統稱為「成分基金」)。iShares安碩核心恒生指數ETF的首個財務報告期間將為截至二零一七年十二月三十一日止期間。

於二零一六年十一月十八日,管理人發出公告及通告,建議下列成分基金停止交易、終止、自願撤銷認可資格及除牌。終止日期為二零一七年二月二十四日。

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)

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)

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)

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)

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)

iShares安碩人民幣債券指數ETF

於二零一七年一月二十日,管理人發出公告及通告,建議iShares安碩滬深A股金融指數ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)停止交易、終止、自願撤銷認可資格及除牌。預期終止日期為二零一七年四月二十八日或前後。

證監會已批准所有七個終止成分基金獲豁免嚴格遵守單位信託及互惠基金守則。豁免允許於二零一六年一月一日至終止日期編製最後財務報表。

有關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)、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)、iShares安碩滬深A股金融指數ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)、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)、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)、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)及iShares安碩人民幣債券指數ETF(「終止成分基金」)的財務資料並無於本年度報告中載列,但將與終止成分基金的終止審計合併,覆蓋二零一六年一月一日至終止日的期間。

信託基金的管理人為貝萊德資產管理北亞有限公司(「管理人」),而信託人為滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司(「信託人」)。

### **iShares安碩MSCI中國指數ETF(「MSCI中國ETF」)**

MSCI中國ETF的目標為提供在未扣除收費及開支前,與MSCI中國指數表現非常接近的投資回報。基礎指數的設計,是要追蹤(i)在香港聯交所上市的中國證券(包括H股、紅籌股及P股);(ii)在上海證券交易所及深圳證券交易所上市的中國證券B股及(iii)於分類國家以外進行買賣的公司(即境外上市公司,包括以預託證券方式進行買賣的公司)股市表現。

### **iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF(「MSCI中國A股ETF」)**

MSCI中國A股ETF的目標為提供在未扣除收費及開支前,與MSCI中國A股國際指數表現非常接近的投資回報。MSCI中國A股國際指數覆蓋上海證券交易所及深圳證券交易所的大中型股並包括MSCI中國全股指數(MSCI China All Shares Index)的中國A股成分股。MSCI中國A股ETF可透過人民幣合格境外機構投資者(「RQFII」),額度及股票市場交易互联互通機制投資於中國A股。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF\*( \*此基金為一隻合成交易所買賣基金)(「A50 中國 ETF」)

A50 中國 ETF 的目標為提供在未扣除收費及開支前，與富時中國 A50 指數表現非常接近的投資回報。截至二零一三年八月二日，A50 中國 ETF 並無直接持有 A 股，而是透過中國 A 股連接產品(「CAAP」)投資富時中國 A50 指數。自二零一三年八月二日起，除 CAAP 外，A50 中國 ETF 亦直接投資於 A 股。CAAP 僅負有各 CAAP 發行人(「CAAP 發行人」)提供與持有相關 A 股或 A 股指數等等的經濟表現的責任。

截至二零一六年十二月三十一日，A50 中國 ETF 有十七名(二零一五年：十六名)參與證券商及六名(二零一五年：七名)CAAP 發行人。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日的 CAAP 發行人名單載於附註 11(b)。

### iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF(前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)(「SENSEX 印度 ETF」)

SENSEX 印度 ETF 的目標為提供在未扣除收費及開支前，與標普 BSE SENSEX 指數表現非常接近的投資回報。

iShares BSE SENSEX Mauritius Company，一間於毛里求斯註冊成立由 SENSEX 印度 ETF 全資擁有的附屬公司(「毛里求斯附屬公司」)，以代表 SENSEX 印度 ETF 持有印度證券及印度連接產品(「IAP」)。

SENSEX 印度 ETF 可最多將資產淨值的 15% 投資於 IAP，而於任何單一發行人的投資最多為資產淨值的 10%。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，SENSEX 印度 ETF 並無持有任何 IAP。

自二零一六年十月十四日起，iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF 的名稱更改為 iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF。

### iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)(「MSCI 亞洲(日本除外)ETF」)

MSCI 亞洲(日本除外)ETF 的目標為提供在未扣除收費及開支前，與 MSCI 綜合亞洲除日本指數，及於二零一五年七月二十七日前與 MSCI 亞洲 APEX 50 指數表現非常接近的投資回報。MSCI 綜合亞洲除日本指數包括符合交易標準的大型及中型股票，而 MSCI 亞洲 APEX 50 指數包括符合交易標準的 50 隻最大股票。

自二零一六年十月十四日起，iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF 的名稱更改為 iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF。自二零一五年七月二十七日起，由於變更基礎指數，iShares 安碩 MSCI 亞洲 APEX 50 指數 ETF 更名為 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF。自二零一五年七月二十七日起，基礎指數由 MSCI 亞洲 APEX 50 指數變更為 MSCI 綜合亞洲除日本指數。

### iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF(「MSCI 亞洲新興市場 ETF」)

MSCI 亞洲新興市場 ETF 的目標為提供在未扣除收費及開支前，與 MSCI 新興亞洲指數表現非常接近的投資回報。MSCI 亞洲新興市場 ETF 旨在追蹤亞洲新興國家的股市表現。MSCI 亞洲新興市場 ETF 並非已向印度證券交易委員會(「SEBI」)註冊的外國組合投資者(「FPI」)，現正投資於 SENSEX 印度 ETF，以取得參與 MSCI 新興亞洲指數於印度市場分部的投資的機會。MSCI 亞洲新興市場 ETF 不會因持有 SENSEX 印度 ETF 而須繳納額外管理費用(詳情請參閱附註 7(a))。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)(「滬深300 A股ETF」)

滬深300 A股ETF的目標為提供在未扣除收費及開支前，與滬深300指數表現非常接近的投資回報。滬深300指數為一隻由300隻在上海和深圳證券交易所買賣的成分股組成的多元化指數。於二零一六年十一月二十一日之前，滬深300 A股ETF並無直接持有A股，而是透過投資於一系列iShares安碩滬深行業指數基金<sup>1</sup>及CAAP或僅投資於CAAP投資滬深300指數。自二零一六年十一月二十一日起，除iShares安碩滬深行業指數基金及CAAP外，滬深300 A股ETF直接投資於A股。CAAP僅負有各CAAP發行人提供與持有相關A股等相同的經濟表現的責任。滬深300 A股ETF不會因持有滬深行業指數基金而須繳納額外管理費用(詳情請參閱附註7(a))。截至二零一六年十二月三十一日，除CAAP外，滬深300 A股ETF直接投資於A股。截至二零一五年十二月三十一日，滬深300 A股ETF僅投資於CAAP。

截至二零一六年十二月三十一日，滬深300 A股ETF有十四名(二零一五年：十四名)參與證券商及三名(二零一五年：三名)CAAP發行人。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日的CAAP發行人名單載於附註11(b)。

### iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF(「韓國綜合股價200ETF」)

韓國綜合股價200ETF目標為提供在未扣除收費及開支前，與KOSPI 200淨總回報美元指數表現非常接近的投資回報。KOSPI 200淨總回報美元指數為根據於韓國股票市場上市的200間藍籌公司編製的自由流通調整市值加權指數，其成分股乃基於市場及行業代表性及流通性等因素挑選。KOSPI 200淨總回報美元指數由韓國交易所計算及維持。KOSPI 200淨總回報美元指數乃淨總回報指數，意指計算KOSPI 200淨總回報美元指數的表現時，以扣減稅項後之股息再投資為基準。

### iShares安碩核心MSCI台灣指數ETF(「MSCI台灣ETF」)

MSCI台灣ETF目標為提供在未扣除收費及開支前，與MSCI台灣指數表現非常接近的投資回報。MSCI台灣指數為涵蓋台灣可投資股票範圍約85%公司的自由流通調整市值指數，按扣減稅項後之股息再投資後的淨總回報計算(須符合整體最小規模要求)。MSCI台灣指數由MSCI Inc.計算及維持。

### iShares安碩德國DAX指數ETF(「DAXETF」)

DAXETF目標為提供在未扣除收費及開支前，與德國DAX指數表現非常接近的投資回報。德國DAX指數為追蹤法蘭克福證券交易所之30家最大且最重要公司(稱為藍籌公司)的部分的自由流通調整市值加權指數。德國DAX指數由Deutsche Börse AG計算及維持。德國DAX指數乃合計總回報指數，意指計算德國DAX指數的表現時，以扣減稅項前之股息再投資為基準。

<sup>1</sup> 個別或統稱為「滬深行業指數基金」。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### iShares 安碩歐元區 STOXX 50 指數 ETF(「歐元區 STOXX 50 ETF」)

歐元區 STOXX 50 ETF 目標為提供在未扣除收費及開支前，與歐元區 STOXX 50 指數表現非常接近的投資回報。歐元區 STOXX 50 指數為自由流通調整市值加權指數。其代表 12 個歐元區國家內按自由流通市值計算的最大 50 間稱之為藍籌股的公司。歐元區 STOXX 50 指數由勢拓有限公司計算及維持。歐元區 STOXX 50 指數乃淨總回報指數，意指計算歐元區 STOXX 50 指數的表現時，以扣減稅項後之股息再投資為基準。

### iShares 安碩富時 100 指數 ETF(「富時 100 ETF」)

富時 100 ETF 目標為提供在未扣除收費及開支前，與富時 100 指數表現非常接近的投資回報。富時 100 指數為一項英國上市藍籌公司的自由流通市值加權指數。其乃用作計量於倫敦證券交易所(「倫敦證交所」)上市的市值總額(即實行任何可投資比重前)首 100 家英國公司之表現。富時 100 指數由富時國際有限公司(FTSE International Limited,「富時」)計算及維持。富時 100 指數乃淨總回報指數，意指計算富時 100 指數的表現時，以扣減稅項後之股息再投資為基準。

### iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF(「納斯達克 100 ETF」)

納斯達克 100 ETF 目標為提供在未扣除收費及開支前，與納斯達克 100 指數表現非常接近的投資回報。納斯達克 100 指數為一項經修訂市值加權指數。其包括於納斯達克證券交易所有限公司(「納斯達克」)上市的市值首 100 家美國及國際非金融公司。納斯達克 100 指數由 The NASDAQ OMX Group Inc. 或其聯屬公司計算及維持。納斯達克 100 指數乃淨總回報指數，意指計算納斯達克 100 指數的表現時，以扣減稅項後之股息再投資為基準。

## 2 主要會計政策概要

編製該等財務報表時所採用的主要會計政策如下。除另有說明外，此等政策已貫徹應用於所有呈報期間。

### (a) 編製基準

成分基金的財務報表乃根據國際財務報告準則(「國際財務準則」)編製。財務報表按歷史成本法編製，並根據按公平價值透過損益記賬的金融資產及負債(包括衍生金融工具)的重估而作出修訂。

按照國際財務準則編製財務報表時，須作出若干關鍵會計估算。管理人及信託人(「管理層」)亦須在應用成分基金的會計政策時運用其判斷。涉及較高判斷性或較複雜的範疇，或涉及對財務報表作出重大假設和估算的範疇，於附註 3 披露。

SENSEX 印度 ETF 符合國際財務準則第 10 號所界定的投資實體的定義，並須將其於附屬公司毛里求斯附屬公司的投資按公平價值透過損益記賬。

## 財務報表附註(續)

SENSEX印度ETF的財務報表為SENSEX印度ETF呈列的唯一財務報表。

### 於二零一六年一月一日生效的準則及現有準則的修訂

概無自二零一六年一月一日開始的財政年度首次生效並預期會對成分基金產生重大影響的其他準則、詮釋或現有準則的修訂。

### 已頒佈但於二零一六年一月一日開始的財政年度尚未生效且未被提早採納的新準則、修訂及詮釋

披露計劃：國際會計準則第7號的修訂，該修訂於二零一七年一月一日或之後開始的年度期間生效。今後，實體需要解釋融資活動產生的負債變動，包括來自現金流量的變動(例如借款的減少及償付)以及非現金的變動，例如收購、出售、權益增加及未變現匯兌差額。倘現金流量已經或將會計入來自融資活動的現金流量，金融資產變動必須計入本披露內。例如，這可能適用於對沖融資負債產生的負債的資產。實體可將其他項目的變動列為本披露的一部分，例如提供「淨債務」的對賬。然而，在此情況下，其他項目的變動必須與融資活動產生的負債變動分開披露。資料可以列表方式披露為期初及期末結餘的對賬，惟並非強制採用特定格式。該準則預期不會對成分基金的財務狀況或表現造成任何重大影響。

國際財務準則第9號「金融工具」針對金融資產和金融負債的分類、計量和確認。國際財務準則第9號的完整版本於二零一四年七月頒佈。其取代了國際會計準則第39號有關金融工具分類及計量的指引。國際財務準則第9號保留但簡化了金融資產的混合計量模型，並確定了三個主要的計量類別：按攤銷成本、按公平價值透過其他全面收入以及按公平價值透過損益計量。此分類基準視乎實體的經營模式，以及金融資產的合約現金流量特點。權益工具投資須於初始時連同不可撤銷選擇權按公平價值透過損益計量，以在其他全面收入呈列不會循環入賬的公平價值的變動。目前有新的預期信貸虧損模型，可取代在國際會計準則第39號中使用的已產生虧損減值模型。對於金融負債，就指定為按公平價值透過損益記賬的負債，除了在其他全面收入中確認本身信貸風險的變動外，分類和計量並無任何變動。國際財務準則第9號放寬了對沖有效性的規定，並以清晰界線對沖有效性測試取代。此準則規定被對沖項目與對沖工具的經濟關係以及「對沖比率」須與管理層實際用作風險管理之目的相同。仍須編製同期文件存檔，惟與現時根據國際會計準則第39號之規定有別。該準則於二零一八年一月一日或之後開始的會計期間生效。該準則預期不會對成分基金的財務狀況或表現造成任何重大影響。

概無其他尚未生效的準則、詮釋或現有準則的修訂預期將會對成分基金產生重大影響。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (b) 投資實體

SENSEX 印度 ETF 擁有多名非關聯投資者且透過毛里求斯附屬公司間接持有各項投資。於 SENSEX 印度 ETF 的所有權權益形式為可贖回單位，該等單位根據國際會計準則第 32 號分類為權益，享有來自 SENSEX 印度 ETF 淨資產公平價值變動的可變回報。基於以下情況，SENSEX 印度 ETF 被視作符合國際財務準則第 10 號有關投資實體之定義：

- (i) SENSEX 印度 ETF 已獲得向投資者提供投資管理服務的資金。
- (ii) SENSEX 印度 ETF 的業務宗旨(已直接傳達給投資者)為透過毛里求斯附屬公司進行投資以純粹獲取資本增值及投資收益回報。毛里求斯附屬公司乃為代表 SENSEX 印度 ETF 持有印度證券及 IAP 而成立。
- (iii) 透過毛里求斯附屬公司錄得的投資表現按公平價值計量及評估。

儘管 SENSEX 印度 ETF 並不符合投資實體的所有典型特徵(即 SENSEX 印度 ETF 並無多項投資)，管理層認為其仍為投資實體，原因是其與毛里求斯附屬公司一同成立，且透過毛里求斯附屬公司落實多項投資。因此，SENSEX 印度 ETF 並未編製綜合財務報表。於該等非綜合財務報表中，SENSEX 印度 ETF 於其附屬公司之投資按公平價值透過損益記賬。

### (c) 附屬公司

附屬公司為一間於毛里求斯註冊成立的私人股份有限責任公司，為 SENSEX 印度 ETF 的全資附屬公司。SENSEX 印度 ETF 及其附屬公司按一體化架構運作，據此，SENSEX 印度 ETF 僅對附屬公司進行投資，方式為認購附屬公司的全部參與股份。附屬公司允許按每日基準贖回該等參與股份。

於截至二零一六年十二月三十一日止年度，成分基金贖回的總淨額為 32,977,069 港元(二零一五年：贖回淨額 426,969,332 港元)。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，概不存在資本承擔責任，亦無應付附屬公司的未結清購置款項。

	二零一六年		二零一五年	
	持股量 股份數目	公平價值 港元	持股量 股份數目	公平價值 港元
iShares BSE SENSEX Mauritius Company	42,499,125	797,797,824	44,275,592	826,151,554

毛里求斯附屬公司投資組合的公平價值變動及毛里求斯附屬公司公平價值的相應變動可能令 SENSEX 印度 ETF 引致虧損。

## 財務報表附註(續)

### (d) 投資

#### (i) 分類

成分基金將其投資分類為按公平價值透過損益記賬的金融資產。有關金融資產由管理層在購入時指定為按公平價值透過損益記賬的金融資產。在購入時獲指定為按公平價值透過損益記賬的金融資產乃按成分基金以書面記錄的投資策略管理並按公平價值基準評定其表現。成分基金的政策要求管理層按公平價值基準以及其他有關財務資料評定有關金融資產的資料。

#### (ii) 確認／撤銷確認

購買及出售投資乃按交易日期為基準入賬。當投資收取現金流量的權利屆滿或成分基金已轉讓絕大部分所有權的風險和回報，投資會被撤銷確認。

#### (iii) 計量

投資首次按公平價值為基礎確認。交易成本於全面收入報表中列為開支。

初次確認後，所有投資按公平價值計量。投資變現及未變現的收益及虧損於產生期間在全面收入報表中確認。

#### (iv) 公平價值估計

公平價值為市場參與者於計量日在有序交易中出售資產所得到或轉讓負債所付出之作價。於活躍市場買賣的投資(如公開買賣衍生工具及交易證券)的公平價值乃按於報告日期所報收市價釐定。成分基金使用最後成交市價釐定投資公平價值，而最後成交價在買賣差價之間。倘最後成交價並非處於買賣差價之間，管理層將釐定買賣差價之間內最能反映公平價值的一點。

至於A50中國ETF、滬深300A股ETF持有的CAAP及SENSEX印度ETF持有的IAP，該等投資僅有名義行使價。其公平價值按CAAP及IAP的相關證券所報市價計算，並經下文附註6所述就潛在資本增值稅(如有)預期應付予發行人的款項作出調整。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，SENSEX印度ETF並無持有任何IAP。

非交易所上市或交易疏落的投資使用經紀商報價或按管理人判斷及估計進行估值。債務證券按所報市價(包括應計利息)計量公平價值。

SENSEX印度ETF於毛里求斯附屬公司的投資及毛里求斯附屬公司所持相關投資已初始指定為按公平價值透過損益記賬，原因是該等投資乃根據SENSEX印度ETF的發售文件按組合基準管理，及按公平價值基準評估表現。

毛里求斯附屬公司的公平價值乃根據其行政管理人所呈報的最新資產淨值計量。

## 財務報表附註(續)

(v) 公平價值等級之間的轉移

公平價值等級之間的轉移被視為已於報告期末發生。

### (e) 金融工具的抵銷

若成分基金現時擁有依法可執行權力，可抵銷已確認入賬的金額，且有意以淨額基準結算，或將資產變現並同時清償債務，則金融資產及負債可予抵銷，並於財務狀況報表呈報淨額。依法可執行權力不得視乎未來事件而定，而在日常業務過程中及倘成分基金或交易對手出現違約、無償債能力或破產情況時，亦須具有約束力。

### (f) 應收及應付經紀商款項

應收及應付經紀商款項指已訂約但於報告期末仍未結算或交付的出售證券應收款項及購買證券應付款項。該等金額初次按公平價值確認，其後使用實際利率法以攤銷成本扣除應收經紀商款項的減值撥備計算。當有客觀證據顯示成分基金將不能收回所有應收相關經紀商的款項，應收經紀商款項的減值撥備會獲確立。經紀商遭遇重大財政困難、經紀商將可能破產或進行財務重組，以及拖欠款項或無法如期付款，均顯示應收經紀商款項須進行減值。撥備金額為資產的賬面值與估計日後現金流量按原有實際利率折現的現值的差額。撥備金額於全面收入報表中確認。財務狀況報表內列報的應收經紀商款項已扣除有關撥備。

### (g) 股息收入及銀行利息收入

股息收入按除淨基準入賬。倘無除淨日期，股本證券及 CAAP 的股息收入則於成分基金收取款項的權利獲確立時入賬。

銀行結存的利息收入以實際利率法按時間比例基準於全面收入報表確認。

### (h) 向基金單位持有人派息

向基金單位持有人派息於獲管理人批准時在基金單位持有人應佔資產淨值變動報表確認。

### (i) 開支

開支按應計基準入賬。

### (j) 現金及現金等價物

現金及現金等價物包括手頭現金、活期存款及原到期日為三個月或以內的其他短期高流通性投資以及銀行透支。銀行透支於財務狀況報表中作為流動負債呈列。

## 財務報表附註(續)

### (k) 外幣換算

#### **功能貨幣及呈列貨幣**

#### **MSCI中國ETF、A50中國ETF、SENSEX印度ETF、MSCI亞洲(日本除外)ETF、MSCI亞洲新興市場ETF及滬深300A股ETF**

計入財務報表的項目乃採用成分基金經營業務所在主要經濟環境的貨幣(「功能貨幣」)計量。成分基金表現以港元計量及向基金單位持有人呈報。管理層認為，將港元作為呈列貨幣能最真實地反映相關交易、事件及環境的經濟影響。財務報表乃以港元呈列，而港元亦為各成分基金的功能貨幣及呈列貨幣。

#### **MSCI中國A股ETF**

計入財務報表的項目乃採用成分基金經營業務所在主要經濟環境的貨幣(「功能貨幣」)計量。成分基金表現以人民幣(「人民幣」)計量及向基金單位持有人呈報。管理層認為，將人民幣作為呈列貨幣能最真實地反映相關交易、事件及環境的經濟影響。財務報表乃以人民幣呈列，而人民幣亦為各成分基金的功能貨幣及呈列貨幣。

#### **韓國綜合股價200ETF、MSCI台灣ETF及納斯達克100ETF**

計入財務報表的項目乃採用成分基金經營業務所在主要經濟環境的貨幣(「功能貨幣」)計量。成分基金表現以美元(「美元」)計量及向基金單位持有人呈報。管理層認為，將美元作為呈列貨幣能最真實地反映相關交易、事件及環境的經濟影響。財務報表乃以美元呈列，而美元亦為各成分基金的功能貨幣及呈列貨幣。

#### **DAXETF及歐元區STOXX50ETF**

計入財務報表的項目乃採用成分基金經營業務所在主要經濟環境的貨幣(「功能貨幣」)計量。成分基金表現以歐元(「歐元」)計量及向基金單位持有人呈報。管理層認為，將歐元作為呈列貨幣能最真實地反映相關交易、事件及環境的經濟影響。財務報表乃以歐元呈列，而歐元亦為各成分基金的功能貨幣及呈列貨幣。

#### **富時100ETF**

計入財務報表的項目乃採用成分基金經營業務所在主要經濟環境的貨幣(「功能貨幣」)計量。成分基金表現以英鎊(「英鎊」)計量及向基金單位持有人呈報。管理層認為，將英鎊作為呈列貨幣能最真實地反映相關交易、事件及環境的經濟影響。財務報表乃以英鎊呈列，而英鎊亦為成分基金的功能貨幣及呈列貨幣。

## 財務報表附註(續)

### 交易及結餘

外幣交易均按交易當日的匯率換算為功能貨幣。以外幣計值的資產與負債按期結日匯率換算為功能貨幣。換算產生的匯兌收益及虧損均於全面收入報表內入賬。

有關現金及現金等價物的匯兌收益及虧損乃於全面收入報表的「外幣淨收益／(虧損)」內呈列。有關按公平價值透過損益記賬的金融資產及負債的匯兌收益及虧損乃於全面收入報表的「按公平價值透過損益記賬的金融資產淨收益／(虧損)」內呈列。

### (l) 可贖回單位

成分基金發行可贖回單位，持有人可按自己的選擇贖回，該等單位為已發行的最次級單位，因此，分類為權益。

### (m) 稅務

#### 預扣稅

成分基金目前須就投資收入繳付若干國家的預扣稅。有關收入在全面收入報表以總收入(即計及預扣稅)記錄。預扣稅於全面收入報表中計作「稅項」。

#### 資本增值稅

本期間的資本增值稅開支包括當期及遞延稅項。稅項在全面收入報表中確認，但與在其他全面收入中或直接在股本中確認的項目有關者則除外。在該情況下，稅項亦分別在其他全面收入或直接在股本中確認。

當期稅項開支根據成分基金經營及產生應課稅收入的國家於報告期末已頒佈或實質上已頒佈的稅法計算。管理層對因應有待詮釋或判斷的稅務法規適用的情況而採取的部署進行定期評估，並在適用情況下根據預期須向稅務機關支付的款項設定撥備。

遞延稅項乃根據財務報表內資產及負債的稅基與賬面值之間的暫時性差異使用負債法確認。遞延稅項採用在報告期末前已頒佈或實質頒佈，並在有關的遞延稅項資產變現或遞延稅項負債清償時預期將會適用的稅率(及法律)釐定。

遞延稅項資產僅就日後很可能獲得應課稅溢利以用作抵扣暫時性差異時確認。

當有法可依將當期稅項資產與當期稅項負債抵銷，以及當遞延稅項資產和負債涉及由同一稅務機關對應課稅實體或不同應課稅實體徵收所得稅但有意向以淨額基準結算結餘時，則可將遞延稅項資產與負債互相抵銷。

## 財務報表附註(續)

### (n) 借出證券

由於A50中國ETF及滬深300 A股ETF有權收取借出的CAAP的股息收入，並保留絕大部分風險及回報，因此借出的CAAP計入此等成分基金的投資組合內。此等成分基金所支付的相關借出證券費用於全面收入報表列賬。

就所借出證券而收取的抵押品一般包括股份、固定收入或現金抵押品。收取的股份及固定收入抵押品被視為賬外交易，因此不計入財務狀況報表，原因是A50中國ETF及滬深300 A股ETF無權收取股份及固定收入抵押品的股息及利息收入，亦不保留絕大部分風險及回報。就股份及固定收入抵押品收取的股息及利息會支付予向有關成分基金提供抵押品的交易對手。收取的現金抵押品(如有)被視為賬內交易，相應負債單獨呈列。從現金抵押品獲取的收入於全面收入報表確認為收入。

由借出CAAP而收取的股息收入於全面收入報表獲確認為A50中國ETF及滬深300 A股ETF的收入。

### (o) 呈列方式變動及可資比較資料

倘財務報表中的項目的呈列方式或分類發生變動，則更新可資比較金額，以符合本年度的呈列方式或分類。

## 3 關鍵會計估計及判斷

按照國際財務準則編製財務報表時，管理層須作出估計及假設，而此等估計及假設會影響財務報表及隨附附註內呈報的數額。實際數字可能與估計有所不同。

管理層須對未來作出估計及假設。所得會計估計數字，因其性質使然，很少等同於有關實際結果。有重大風險可能導致下一個財政期間的資產及負債賬面值須作出重大調整的估算及假設載列如下。

### (a) 功能貨幣

#### MSCI中國ETF、A50中國ETF、SENSEX印度ETF、MSCI亞洲(日本除外)ETF、MSCI亞洲新興市場ETF及滬深300 A股ETF

管理層認為港元為最能真實反映相關交易、事件及環境的經濟影響的貨幣。港元為成分基金計算表現及報告績效，以及於發行或贖回時釐定每單位資產淨值所用的貨幣單位。此決定亦考慮到成分基金均於香港聯交所上市，其單位以港元報價。

#### MSCI中國A股ETF

管理層認為人民幣為最能真實反映相關交易、事件及環境的經濟影響的貨幣。人民幣為成分基金計算表現及報告績效，以及於發行或贖回時釐定每單位資產淨值所用的貨幣單位。此決定亦考慮到成分基金於香港聯交所上市，其單位以人民幣報價。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### **韓國綜合股價200 ETF、MSCI台灣ETF及納斯達克100 ETF**

管理層認為美元為最能真實反映相關交易、事件及環境的經濟影響的貨幣。美元為成分基金計算表現及報告績效，以及於發行或贖回時釐定每單位資產淨值所用的貨幣單位。此決定亦考慮到成分基金均於香港聯交所上市，其單位以美元報價。

### **DAX ETF 及歐元區STOXX 50 ETF**

管理層認為歐元為最能真實反映相關交易、事件及環境的經濟影響的貨幣。歐元為成分基金計算表現及報告績效，以及於發行或贖回時釐定每單位資產淨值所用的貨幣單位。

### **富時100 ETF**

管理層認為英鎊為最能真實反映相關交易、事件及環境的經濟影響的貨幣。英鎊為成分基金計算表現及報告績效，以及於發行或贖回時釐定每單位資產淨值所用的貨幣單位。

## 財務報表附註(續)

### (b) 並無於活躍市場報價的證券的公平價值

管理層可透過使用有信譽的定價來源(例如定價代理)釐定並無於活躍市場報價的證券的公平價值。從定價來源獲得的經紀報價可能具有指標性,但無法被執行且不具有約束力。管理層將作出判斷,並估計所使用定價來源的數量及質素。倘無法獲得市場數據,管理層或會使用其本身的模式對持倉進行估值,該等模式通常基於一般被認為是業內標準的估值方法及技術。該等模式的輸入數據主要為市盈率及折現現金流量。用於釐定公平價值的模式由管理人內有經驗的人員確認及定期審閱。

使用模式時儘可能採用可觀察數據。然而,管理層仍需就例如信貸風險(本身及交易對手)、波動及相互關係之範疇作出估計。倘有關該等因素之假設出現變動,可能會對金融工具所呈報之公平價值造成影響。釐定何為「可觀察」須管理層作出重大判斷。管理層認為可觀察數據為容易獲取、定期分發或更新、可靠及可被核實、非專屬及由活躍參與相關市場的獨立來源所提供的市場數據。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### 4 可贖回單位的變動

可贖回單位的變動載列如下：

	iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF 單位數目		iShares 安碩 MSCI 中國 A 股 國際指數 ETF 單位數目
	二零一六年 一月一日至 二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 一月一日至 二零一五年 十二月三十一日	二零一六年 一月二十五日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日
年初／期初已發行單位	127,800,000	59,400,000	-
發行單位	14,400,000	166,200,000	19,500,000
贖回單位	(66,000,000)	(97,800,000)	(9,000,000)
年終／期終已發行單位	76,200,000	127,800,000	10,500,000
	港元	港元	人民幣
會計資產淨值(每單位)	18.49	18.88	6.29

	iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF 單位數目		iShares 安碩滬深 300 A 股指數 ETF* (* 此基金為一隻合成交易所買賣基金) 單位數目	
	二零一六年 一月一日至 二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 一月一日至 二零一五年 十二月三十一日	二零一六年 一月一日至 二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 一月一日至 二零一五年 十二月三十一日
年初／期初已發行單位	3,200,000	3,600,000	10,000,000	13,000,000
發行單位	-	-	-	-
贖回單位	(200,000)	(400,000)	(2,000,000)	(3,000,000)
年終／期終已發行單位	3,000,000	3,200,000	8,000,000	10,000,000
	港元	港元	港元	港元
會計資產淨值(每單位)	39.75	38.29	24.21	29.25

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF* (* 此基金為一隻合成交易所買賣基金) 單位數目		iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF) 單位數目		iShares 安碩核心 MSCI 亞洲 (日本除外) 指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲 (日本除外) 指數 ETF) 單位數目	
二零一六年 一月一日至 二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 一月一日至 二零一五年 十二月三十一日	二零一六年 一月一日至 二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 一月一日至 二零一五年 十二月三十一日	二零一六年 一月一日至 二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 一月一日至 二零一五年 十二月三十一日
3,510,000,000	6,326,000,000	46,600,000	68,600,000	2,400,000	2,400,000
24,000,000	920,000,000	800,000	2,400,000	103,280,000	1,600,000
(880,000,000)	(3,736,000,000)	(2,400,000)	(24,400,000)	(480,000)	(1,600,000)
2,654,000,000	3,510,000,000	45,000,000	46,600,000	105,200,000	2,400,000
港元	港元	港元	港元	港元	港元
10.86	12.24	17.77	17.77	40.04	38.32
iShares 安碩 核心韓國綜合 股價 200 指數 ETF 單位數目	iShares 安碩 核心 MSCI 台灣指數 ETF 單位數目	iShares 安碩 德國 DAX 指數 ETF 單位數目	iShares 安碩 歐元區 STOXX 50 指數 ETF 單位數目	iShares 安碩 富時 100 指數 ETF 單位數目	iShares 安碩 納斯達克 100 指數 ETF 單位數目
二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日
-	-	-	-	-	-
18,600,000	24,200,000	8,600,000	8,600,000	8,600,000	12,400,000
(6,000,000)	(6,600,000)	(2,800,000)	(3,600,000)	(3,800,000)	(5,600,000)
12,600,000	17,600,000	5,800,000	5,000,000	4,800,000	6,800,000
美元	美元	歐元	歐元	英鎊	美元
1.07	1.13	1.05	1.02	0.83	1.15

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### 5 按公平價值透過損益記賬的金融資產淨收益/(虧損)

	iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF		iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF
	二零一六年一月一日至二零一六年十二月三十一日 港元	二零一五年一月一日至二零一五年十二月三十一日 港元	二零一六年一月二十五日(成立日期)至二零一六年十二月三十一日 人民幣
按公平價值透過損益記賬的金融資產價值未變現收益/虧損的變動	170,008,941	(520,123,461)	3,466,346
出售按公平價值透過損益記賬的金融資產已變現收益/(虧損)淨額	(262,538,773)	(273,171,035)	2,743,533
	(92,529,832)	(793,294,496)	6,209,879

	iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF		iShares 安碩滬深 300 A 股指數 ETF* (* 此基金為一隻合成交易所買賣基金)	
	二零一六年一月一日至二零一六年十二月三十一日 港元	二零一五年一月一日至二零一五年十二月三十一日 港元	二零一六年一月一日至二零一六年十二月三十一日 港元	二零一五年一月一日至二零一五年十二月三十一日 港元
按公平價值透過損益記賬的金融資產價值未變現收益/虧損的變動	6,305,361	(19,021,435)	(32,421,575)	(87,836,864)
出售按公平價值透過損益記賬的金融資產已變現收益/(虧損)淨額	(1,014,103)	(179,859)	(11,516,325)	118,552,030
	5,291,258	(19,201,294)	(43,937,900)	30,715,166

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF* (* 此基金為一隻合成交易所買賣基金)		iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)		iShares 安碩核心 MSCI 亞洲 (日本除外) 指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲 (日本除外) 指數 ETF)	
二零一六年 一月一日至 二零一六年 十二月三十一日 港元	二零一五年 一月一日至 二零一五年 十二月三十一日 港元	二零一六年 一月一日至 二零一六年 十二月三十一日 港元	二零一五年 一月一日至 二零一五年 十二月三十一日 港元	二零一六年 一月一日至 二零一六年 十二月三十一日 港元	二零一五年 一月一日至 二零一五年 十二月三十一日 港元
(5,972,140,103)	(25,470,301,652)	(4,048,118)	(206,148,855)	(73,342,706)	(39,231,402)
1,646,311,431	24,658,115,395	8,672,883	114,582,202	3,717,910	24,888,603
(4,325,828,672)	(812,186,257)	4,624,765	(91,566,653)	(69,624,796)	(14,342,799)
iShares 安碩 核心韓國綜合 股價 200 指數 ETF	iShares 安碩 核心 MSCI 台灣指數 ETF	iShares 安碩 德國 DAX 指數 ETF	iShares 安碩 歐元區 STOXX 50 指數 ETF	iShares 安碩 富時 100 指數 ETF	iShares 安碩 納斯達克 100 指數 ETF
二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 歐元	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 歐元	二零一六年 六月二十三日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 英鎊	二零一六年 六月二十二日 (成立日期)至 二零一六年 十二月三十一日 美元
(94,240)	713,087	642,472	426,160	437,049	722,138
237,639	511,252	287,211	207,956	289,698	666,332
143,399	1,224,339	929,683	634,116	726,747	1,388,470

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### 6 稅務

由於成分基金根據香港證券及期貨條例第 104 條獲認可為集體投資計劃，因此根據香港稅務條例第 26A(1A) 條獲豁免繳納利得稅，故並無就香港利得稅作出撥備。

各成分基金的稅務指：

	iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF		iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF	iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)	
	二零一六年一月一日至二零一六年十二月三十一日 港元	二零一五年一月一日至二零一五年十二月三十一日 港元	二零一六年一月二十五日(成立日期)至二零一六年十二月三十一日 人民幣	二零一六年一月一日至二零一六年十二月三十一日 港元	二零一五年一月一日至二零一五年十二月三十一日 港元
<b>稅務</b>					
－股息收入預扣稅	3,757,730	9,074,879	235,205	93,863,909	119,990,585
－利息收入預扣稅	-	-	343	71,328	14,083
	3,757,730	9,074,879	235,548	93,935,237	120,004,668

	iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)		iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF (前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)		iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF	
	二零一六年一月一日至二零一六年十二月三十一日 港元	二零一五年一月一日至二零一五年十二月三十一日 港元	二零一六年一月一日至二零一六年十二月三十一日 港元	二零一五年一月一日至二零一五年十二月三十一日 港元	二零一六年一月一日至二零一六年十二月三十一日 港元	二零一五年一月一日至二零一五年十二月三十一日 港元
<b>稅務</b>						
－股息收入預扣稅	-	-	3,541,807	403,241	427,046	539,474
－利息收入預扣稅	-	-	50	13	-	-
	-	-	3,541,857	403,254	427,046	539,474

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	iShares 安碩滬深300 A股指數ETF*( *此基金為一隻合成交易所買賣基金)		iShares 安碩核心韓國綜合股價200指數ETF	iShares 安碩核心MSCI台灣指數ETF	iShares 安碩德國DAX指數ETF
	二零一六年一月一日至二零一六年十二月三十一日 港元	二零一五年一月一日至二零一五年十二月三十一日 港元	二零一六年六月二十二日(成立日期)至二零一六年十二月三十一日 美元	二零一六年六月二十二日(成立日期)至二零一六年十二月三十一日 美元	二零一六年六月二十三日(成立日期)至二零一六年十二月三十一日 歐元
<b>稅務</b>					
－股息收入預扣稅	443,152	620,092	48,562	162,286	980
－利息收入預扣稅	123	-	-	-	-
	443,275	620,092	48,562	162,286	980

	iShares 安碩歐元區STOXX 50指數ETF	iShares 安碩富時100指數ETF	iShares 安碩納斯達克100指數ETF
	二零一六年六月二十三日(成立日期)至二零一六年十二月三十一日 歐元	二零一六年六月二十三日(成立日期)至二零一六年十二月三十一日 英鎊	二零一六年六月二十三日(成立日期)至二零一六年十二月三十一日 美元
<b>稅務</b>			
－股息收入預扣稅	10,372	625	25,214
	10,372	625	25,214

### 印度資本增值稅

SENSEX印度ETF透過毛里求斯附屬公司投資印度市場，毛里求斯附屬公司投資於在印度市場交易的證券且預計將獲得毛里求斯與印度之間的雙重徵稅協定下的優惠。為於該協定中獲益，毛里求斯附屬公司每年均須符合若干檢驗標準及條件，包括認定毛里求斯稅務常駐及相關規定。毛里求斯附屬公司已自毛里求斯稅務當局取得稅務常駐證(「稅務常駐證」)，而由於其並無於印度設立分支機構或常設機構，故其將毋須就出售證券繳納印度資本增值稅。

## 財務報表附註(續)

於二零一六年五月十日，印度稅務局宣佈分階段取消印度一毛里求斯稅務協定項下現有的增值稅(「增值稅」)豁免。該變動將自二零一七年四月一日起生效，意味著於二零一七年四月一日或之後，印度有權對銷售由毛里求斯實體收購的印度居民公司股份徵收增值稅。於二零一七年四月一日前收購的股份毋須於印度繳稅。然而，分階段取消消息指於二零一七年四月一日至二零一九年三月三十一日的過渡期間，稅率將以印度國內稅率的50%為限，並須遵守利益限制條款。於印度以全額國內稅率徵收稅項將適用於二零一九年至二零二零年以後財政年度。

管理人將繼續審閱協定變動及印度稅法變動對毛里求斯附屬公司的影響。

已收一間印度附屬公司並已向股東派付股息分派稅的的股份股息獲豁免繳納稅項。派付股息的印度公司有責任支付15%的股息分派稅(加適用附加稅及教育稅)。

上述情況乃以現行詮釋及慣例為依據，可能受印度及毛里求斯稅法以及印度與毛里求斯之間的徵稅協定的任何日後變動規限。

### 毛里求斯所得稅

毛里求斯附屬公司的收入及資本增值稅受毛里求斯及毛里求斯附屬公司投資所在國家的財政法及慣例規限。以下為按毛里求斯附屬公司經營所在司法權區劃分的現行稅法概要。

毛里求斯附屬公司由毛里求斯集中管理及控制，因此屬毛里求斯稅務常駐企業。毛里求斯附屬公司投資於在印度市場交易的證券，毛里求斯附屬公司預計將獲得毛里求斯與印度之間的雙重徵稅協定下的優惠。出售單位及證券產生的資本增值獲豁免繳納毛里求斯稅項，而毛里求斯附屬公司向其股東派付的任何股息均獲豁免於毛里求斯繳納任何預扣稅。

根據現行法律及法規，毛里求斯附屬公司須按15%的稅率(二零一五年：15%)就其截至二零一六年十二月三十一日止財政年度的收入淨額繳納所得稅。然而，毛里求斯附屬公司有權享受稅項抵免，數額相當於實際繳納的海外稅項或就其海外來源收入繳納的毛里求斯稅項的80%二者中的較高者，故將其最高實際稅率減低至3%。持有印度公司股本至少5%並收取股息的公司可要求抵免印度公司就其溢利(其中股息自該溢利中分派，包括股息分派稅)支付的稅項。毛里求斯附屬公司出售證券的資本增值毋須繳納毛里求斯所得稅。

### 中國股息預扣稅

MSCI中國A股ETF、A50中國ETF及滬深300A股ETF於中國上市公司A股的投資乃直接透過管理人的QFII及RQFII額額持有或透過一名或多名QFII或其聯屬公司發行的CAAP持有。就所有源自中國的股息會從源頭預扣10%稅項。

### 中國資本增值稅

編製該等財務報表時，管理層已就稅務承擔作出若干假設並使用多項估計，稅務承擔視乎未來可能發生的事情而定。所得出的會計估計數字不一定與相關實際數字相同。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### MSCI中國ETF、MSCI亞洲(日本除外)ETF及MSCI亞洲新興市場ETF

成分基金可能投資在香港聯交所上市的中國證券(包括H股、紅籌股及P股)、在上海證券交易所及深圳證券交易所上市的中國證券B股及預託證券。根據中國企業所得稅法,成分基金或須就買賣該等證券變現的資本增值繳納中國稅項。然而,基於下列原因管理人並未於財務報表中就該等收益產生的稅項計提撥備:管理人認為,根據現行稅務法規,成分基金可以維持不呈交稅務報表的現狀,且不大可能會徵收有關中國資本增值稅。

### MSCI中國A股ETF

成分基金透過RQFII 額度及股票市場交易互聯互通機制投資於中國A股。根據中國財政部(「財政部」)、中國證券監督管理委員會(「中國證監會」)及國家稅務總局(「國稅總局」)在國務院批准下發佈的79號通知、81號通知及127號通知,向(i)合格境外機構投資者(「QFII」)/RQFII;及(ii)透過股票市場交易互聯互通機制買賣A股的外國投資者於二零一四年十一月十七日或之後買賣A股產生的資本增值發出臨時納稅豁免。由於成分基金於該臨時豁免獲授出後開始營運,故並未於財務報表中就該等收益產生的稅項計提撥備。

### A50中國ETF

成分基金直接投資於中國證券A股。根據中國企業所得稅法,如成分基金並無擁有中國稅務機構或在中國設立中心管理及控制部門,則成分基金或須透過管理人的QFII及RQFII牌照限額,就買賣該等證券變現的資本增值按10%繳納中國稅項。

根據中國財政部(「財政部」)、中國證券監督管理委員會(「中國證監會」)及國家稅務總局(「國稅總局」)在國務院批准下發佈的79號通知、81號通知及127號通知,向(i)QFII/RQFII;及(ii)透過股票市場交易互聯互通機制買賣A股的外國投資者於二零一四年十一月十七日或之後買賣A股產生的資本增值發出臨時納稅豁免。然而,79號通知亦明確訂明凡於二零一四年十一月十七日前由QFII/RQFII變現的任何收益須根據法律繳稅。

根據79號通知、81號通知及127號通知,管理人調整了A50中國ETF有關其A股直接投資的撥備政策。因此,A50中國ETF目前不再就未變現資本增值或於二零一四年十一月十七日或之後變現的資本增值計提撥備。就A50中國ETF通過其QFII與RQFII限額作出的A股直接投資而言,A50中國ETF已向中國稅務機構申請於各項雙重稅務協定(「雙重稅務協定」)下的寬免並於其後獲得批准。因此,A50中國ETF於二零一五年十月二十九日的資產淨值已作出正面輕微調整,以反映稅務清算與撥備之間的調整。

分別自二零一三年八月二日、二零一四年九月一日、二零一四年十一月十四日及二零一六年十二月五日起,A50中國ETF透過使用管理人的QFII額度、RQFII額度及透過股票市場交易互聯互通機制直接投資A股。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

下表載列截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度 A50 中國 ETF 中國資本增值稅產生的即期稅務的變動情況：

當期稅項負債	二零一六年 港元	二零一五年 港元
年初	-	182
外幣淨(收益)/虧損	-	(7)
稅項負債撥回	-	(175)
年終	-	-

### CAAP 的估值

#### A50 中國 ETF 及滬深 300 A 股 ETF

A50 中國 ETF 及滬深 300 A 股 ETF 可透過一名或多名 QFII 或其聯屬公司(統稱「CAAP 發行人」)所發行的 CAAP(即與 A 股掛鈎的衍生工具)部分或全部相關指數的投資。

根據中國企業稅法的一般稅務條文，QFII 或須就其出售 A 股產生的收益繳納 10% 的預扣稅。因此，自二零零八年十一月或各成分基金的成立日期(以較遲者為準)起，若干 CAAP 發行人已就 CAAP 已變現收益預扣最多 10% 的款項，而儘管不同的 CAAP 發行人從不同日期開始作出預扣，惟若干 CAAP 發行人的預扣金額均等於彼等認為實際出售所發行的每份 CAAP 所對應 A 股於二零一四年十一月十七日之前之已變現收益應繳納的中國資本增值稅的 10%。

根據於二零一四年十一月十四日發佈的 79 號通知，管理人調整了 A50 中國 ETF 及滬深 300 A 股 ETF 有關其於 CAAP 之相關中國投資之撥備政策。CAAP 發行人不再對於二零一四年十一月十七日或之後所變現的收益預扣 10%，亦不再如先前所協定的於五年後退還所預扣及保留的任何資本增值稅。維持 CAAP 發行人於二零一四年十一月十七日前就已變現收益計提的任何撥備，直至與 CAAP 發行人結算為止。同樣地，成分基金繼續就 CAAP 發行人先前預扣但其後於協定的五年期間屆滿後退還予成分基金的任何款項計提撥備，直至與 CAAP 發行人結算為止。此外，於截至二零一四年十二月三十一日止年度，管理人已根據獨立意見對自二零零八年一月一日或各成分基金的成立日期(以較遲者為準)起直至二零一四年十一月十四日(包括該日)止期間 CAAP 的已變現收益的撥備不足的任何資本增值稅，進一步計提撥備，並將其計入財務狀況報表所披露的其他應付賬款內。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，管理人已同意並清算歸於CAAP發行人的預扣增值稅款項。有關清算導致撥回一部分計入其他應付賬款的撥備及退回先前預扣的增值稅款項，並相應調整按公平價值透過損益記賬的金融資產的淨收益／(虧損)，如下表所披露。

	二零一六年		二零一五年	
	先前預扣 增值稅退回 千港元	撥備撥回 千港元	先前預扣 增值稅退回 千港元	撥備撥回 千港元
<b>A50中國ETF</b>	533,324	477,858	147,531	404,841
<b>滬深300A股ETF</b>	3,181	927	2,308	158

管理人估計，根據相關CAAP發行人及信託人提供的資料，截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日可能須按10%稅率繳納中國稅項的自成分基金各自成立日期起的最高已變現收益概述於下表披露：

	二零一六年	二零一五年
	已變現收益 百萬港元	已變現收益 百萬港元
<b>A50中國ETF</b>	無	32,883.2
<b>滬深300A股ETF</b>	無	84.9

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，CAAP發行人就可能須繳納的中國資本增值稅所預扣的款項如下表披露。有關預扣金額導致財務報表所反映的已變現收益減少。

	二零一六年	二零一五年
	CAAP發行人 預扣的金額 千港元	CAAP發行人 預扣的金額 千港元
<b>A50中國ETF</b>	無	752,545
<b>滬深300A股ETF</b>	無	4,474

根據79號通知，自二零一四年十一月十七日起已停止就未變現收益計提所有撥備，有關結餘已撥回，並對資產淨值產生影響。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### 7 與信託人、管理人及關連人士的交易

下文概述成分基金與信託人、管理人及彼等的關連人士於年內訂立的重大關聯方交易。管理人的關連人士為香港證券及期貨事務監察委員會發出的單位信託及互惠基金守則(「證監會守則」)所界定的關連人士。成分基金與管理人及其關連人士於年內進行的所有交易，均於日常業務過程中按正常商業條款進行。就管理人盡其所知，除下文所披露者外，成分基金概無與關連人士進行任何其他交易。

#### (a) 管理費用

##### MSCI中國ETF

管理人有權收取管理費用，目前按成分基金資產淨值的年率0.59%，每日累計及於每個交易日計算，並於每月月底支付。

##### MSCI中國A股ETF

管理人有權收取管理費用，目前按成分基金資產淨值的年率0.60%，每日累計及於每個交易日計算，並於每月月底支付。截至二零一六年十二月三十一日，成分基金擁有應收管理人款項人民幣32,079元，為代表管理人支付的成分基金開支。

##### A50中國ETF及滬深300A股ETF

管理人有權收取管理費用，目前按各成分基金資產淨值的年率0.99%，每日累計及於每個交易日計算，並於每月月底支付。

##### SENSEX印度ETF

於二零一六年七月一日之前，管理人有權收取管理費用，按成分基金資產淨值的年率0.99%，每日累計及於每個交易日計算，並於每月月底支付。自二零一六年七月一日起，管理費用由成分基金資產淨值的年率0.99%下調至0.64%。

##### MSCI亞洲(日本除外)ETF

於二零一六年七月一日之前，管理人有權收取管理費用，按成分基金資產淨值的年率0.59%，每日累計及於每個交易日計算，並於每月月底支付。自二零一六年七月一日起，管理費用由成分基金資產淨值的年率0.59%下調至0.28%。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，MSCI亞洲(日本除外)ETF投資於由管理人的聯屬公司BlackRock (Singapore) Limited管理的交易所買賣基金iShares安碩MSCI印度指數ETF(「新加坡MSCI印度ETF」)。管理人已豁免新加坡MSCI印度ETF應付的部分管理費用，即MSCI亞洲(日本除外)ETF於新加坡MSCI印度ETF的持股所佔部分。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### MSCI 亞洲新興市場 ETF

管理人有權收取管理費用，目前為成分基金資產淨值的年率0.59%，該費用每日累計及於每個交易日計算，並於每月月底支付。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，管理人已豁免 SENSEX 印度 ETF 應付的部分管理費用，即 MSCI 亞洲新興市場 ETF 於 SENSEX 印度 ETF 的持股所佔部分。

### 韓國綜合股價 200 ETF 及 MSCI 台灣 ETF

管理人有權收取管理費用，目前按各成分基金資產淨值的年率0.30%，每日累計及於每個交易日計算，並於每月月底支付。

### DAX ETF、歐元區 STOXX 50 ETF 及富時 100 ETF

管理人有權收取管理費用，目前按各成分基金資產淨值的年率0.20%，每日累計及於每個交易日計算，並於每月月底支付。

### 納斯達克 100 ETF

管理人有權收取管理費用，目前按成分基金資產淨值的年率0.28%，每日累計及於每個交易日計算，並於每月月底支付。

除下文附註 7(b)至(d)所述的費用及開支外，各成分基金的所有其他費用及開支均由管理人支付。

## (b) 支付予信託人及其關連人士的費用及收費

下表披露於不同市場成分基金就買賣投資及處理 CAAP 發行人抵押品所支付的交易手續費：

市場	交易手續費 美元
澳洲	10
奧地利	30
比利時	20
中國 A 股	22
中國 B 股	45
歐元結算	10
法國	15
芬蘭	20

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

市場	交易手續費 美元
德國	10
希臘	20
香港	10
印度	25
印尼	25
愛爾蘭	20
意大利	15
日本	20
盧森堡	10
馬來西亞	20
荷蘭	20
菲律賓	35
葡萄牙	20
滬港通	10
新加坡	15
南韓	15
西班牙	30
瑞士	15
台灣	30
泰國	20
英國	10
美國	10

就購買、出售及重整投資所支付的行政費為每筆交易 15 美元。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，全面收入報表所呈列的各成分基金的託管及銀行費用由成分基金支付予信託人的關連人士。

應付信託人及其關連人士的一切其他費用均由管理人承擔。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (c) CAAP 運作費用

#### A50 中國 ETF 及 滬深 300 A 股 ETF

CAAP 發行人有權收取 CAAP 運作費用。CAAP 運作費用等於上述成分基金持有的 CAAP 的每日按市值計價的年率 0.3%，按期內實際天數於每季季末支付。

自二零一三年四月一日起，CAAP 發行人放棄收取 CAAP 運作費用。於二零一六年及二零一五年十二月三十一日的 CAAP 發行人名單載於附註 11(b)，當中顯示信託人的最終控股公司 HSBC Bank plc 為 CAAP 發行人之一。

### (d) 按公平價值透過損益記賬的金融資產交易成本

#### A50 中國 ETF 及 滬深 300 A 股 ETF

CAAP 發行人亦就每項為 A50 中國 ETF 及 滬深 300 A 股 ETF 的賬戶進行的 CAAP 買賣收取 0.3% 佣金(不包括印花稅 0.1%)。出售 A 股須支付 0.1% 的印花稅，並於出售時計入 CAAP 的佣金內。

CAAP 的佣金可由管理人與 CAAP 發行人不時議定。信託人的最終控股公司 HSBC Bank plc 為 CAAP 發行人之一。截至二零一六年十二月三十一日止年度，HSBC Bank plc 就 A50 中國 ETF 及 滬深 300 A 股 ETF 分別收取的交易成本為 9,399,993 港元(二零一五年：14,958,121 港元)及 34,547 港元(二零一五年：84,125 港元)。

#### SENSEX 印度 ETF

IAP 發行人亦就每項為毛里求斯附屬公司的賬戶進行的 IAP 買賣收取 0.295% 佣金(包括印度印花稅 0.1%)。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，毛里求斯附屬公司並無持有任何 IAP，因此並無產生任何 IAP 交易成本。

### (e) 銀行結存

銀行結存存置於信託人的一間集團公司(即香港上海滙豐銀行有限公司)。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，由信託人的集團公司持有的銀行結存載列如下：

成分基金	二零一六年 港元	二零一五年 港元
MSCI 中國 ETF	5,114,433	4,771,207
A50 中國 ETF	124,048,147	651,831,415
SENSEX 印度 ETF	2,113,901	2,529,443
MSCI 亞洲(日本除外)ETF	10,430,214	108,995
MSCI 亞洲新興市場 ETF	667,971	621,631
滬深 300 A 股 ETF	1,925,593	2,565,721

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

成分基金	二零一六年 人民幣	二零一五年 人民幣
MSCI中國A股ETF	248,920	不適用

成分基金	二零一六年 美元	二零一五年 美元
韓國綜合股價200ETF	20,887	不適用
MSCI台灣ETF	78,395	不適用
納斯達克100ETF	29,686	不適用

成分基金	二零一六年 歐元	二零一五年 歐元
DAX ETF	16,906	不適用
歐元區STOXX 50 ETF	27,172	不適用

成分基金	二零一六年 英鎊	二零一五年 英鎊
富時100ETF	14,809	不適用

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，全面收入報表所呈列的各成分基金的銀行利息收入自信託人的一間集團公司香港上海滙豐銀行有限公司賺取。

### (f) 銀行透支

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，並無於信託人的集團公司(即香港上海滙豐銀行有限公司)持有銀行透支。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，全面收入報表所呈列的各成分基金的利息開支已支付予香港上海滙豐銀行有限公司。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (g) 銀行透支信貸

信託人同一集團旗下的同系附屬公司香港上海滙豐銀行有限公司(「滙豐」)向下列成分基金授出不受約束的銀行透支信貸額。下列各成分基金的信貸限額須為(以較低者為準): (i) 適用於該成分基金的限額或(ii) 相等於該成分基金的資產淨值的10%的金額, 惟 SENSEX 印度 ETF 除外, 其信貸限額須為(以較低者為準): (i) 應用限額或(ii) 受滙豐、信託人或其任何附屬公司託管的其資產淨值的5%規限的金額。就信託基金的其他成分基金而言, 滙豐可在取得事先批准的情況下為特別融資目的不時授出臨時透支。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日, 下列成分基金可獲得的銀行透支信貸額如下:

成分基金	二零一六年 美元	二零一五年 美元
A50 中國 ETF	50,000,000	50,000,000
SENSEX 印度 ETF	5,000,000	5,000,000
MSCI 亞洲(日本除外)ETF	5,000,000	5,000,000
MSCI 亞洲新興市場 ETF	5,000,000	5,000,000
滬深300 A股 ETF	5,000,000	5,000,000

### (h) 按公平價值透過損益記賬的金融資產

#### MSCI 亞洲(日本除外)ETF

關於成分基金於由管理人的附屬公司 BlackRock (Singapore) Limited 管理的交易所買賣基金新加坡 MSCI 印度 ETF 的投資, 有關詳情請參閱附註 11(a)(l)(v)。

#### MSCI 亞洲新興市場 ETF

關於成分基金於 SENSEX 印度 ETF 的投資, 詳情請參閱附註 11(a)(l)(vi)。

#### 富時 100 ETF

截至二零一六年十二月三十一日, 成分基金於信託人的最終控股公司滙豐控股有限公司投資 289,371 英鎊。

於二零一六年六月二十三日(成立日期)至二零一六年十二月三十一日期間, 成分基金自其於信託人的最終控股公司滙豐控股有限公司的投資中收取股息收入 12,137 英鎊。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (i) 借出證券安排的CAAP、抵押品及借出證券費用

#### A50 中國 ETF

截至二零一六年十二月三十一日，成分基金於信託人的最終控股公司 HSBC Bank plc 發行的 CAAP 中投資 2,038,044,470 港元(二零一五年：5,405,259,611 港元)。HSBC Bank plc 就發行的 CAAP 已向成分基金提供 2,172,187,177 港元的股份及固定收入抵押品。成分基金已向 HSBC Bank Plc 借出 CAAP，並就此收取股份及固定收入抵押品。截至二零一六年十二月三十一日止年度，成分基金就借出證券安排已向 HSBC Bank plc 支付 33,639,198 港元(二零一五年：91,800,808 港元)的借出證券費用。有關詳情請參閱附註 11(b)(ii)。

#### 滬深 300 A 股 ETF

截至二零一六年十二月三十一日，成分基金於信託人的最終控股公司 HSBC Bank plc 發行的 CAAP 中投資 19,784,834 港元(二零一五年：20,804,810 港元)。HSBC Bank plc 就發行的 CAAP 已向成分基金提供 23,159,456 港元的股份及固定收入抵押品。成分基金已向 HSBC Bank Plc 借出 CAAP，並就此收取股份及固定收入抵押品。截至二零一六年十二月三十一日止年度，成分基金就借出證券安排已向 HSBC Bank plc 支付 198,289 港元(二零一五年：70,887 港元)的借出證券費用。有關詳情請參閱附註 11(b)(ii)。

### (j) 基金單位持有人

截至十二月三十一日，下表披露成分基金參與證券商之一香港上海滙豐銀行有限公司(信託人的關聯方)所認購及贖回的單位。

成分基金	二零一六年 認購 / (贖回) 單位	二零一五年 認購 / (贖回) 單位
MSCI 中國 A 股 ETF	9,000,000/(3,000,000)	不適用
A50 中國 ETF	(222,000,000)	(222,000,000)
SENSEX 印度 ETF	800,000	-
韓國綜合股價 200 ETF	2,400,000	不適用
MSCI 台灣 ETF	2,400,000	不適用
DAX ETF	3,800,000	不適用
歐元區 STOXX 50 ETF	3,800,000	不適用
富時 100 ETF	3,800,000	不適用
納斯達克 100 ETF	2,400,000	不適用

## 財務報表附註(續)

### 8 主要非現金交易

#### (a) 認購

於二零零八年十一月十四日之前，基金單位僅可以實物而不可以現金認購。自二零零八年十一月十四日起，基金單位可(a)以實物換取「申請籃子」加「現金成分」認購(其中「申請籃子」指如管理人就有關成分基金於有關日期向參與證券商發出的通知所述，管理人為按申請單位數目創設及贖回基金單位而言，於相關交易日的營業時間開始時就有關成分基金釐定的證券組合；「現金成分」指申請單位的基金單位的資產淨值總額與「申請籃子價值」間的差額；而「申請籃子價值」則指申請籃子所包括的證券於相關交易日的估值時刻的總價值)，或(b)以相當於有關申請籃子價值加相當於任何現金成分數額的現金付款認購，管理人須運用有關現金購入組成申請籃子的證券，以複製適用於成分基金的相關指數，惟管理人有權酌情就有關成分基金向以現金付款代替交付任何證券的任何基金單位申請人，收取額外費用作為稅項及收費的適當撥備。

於截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度/期間內，成分基金透過現金認購及/或為換取申請籃子而發行單位，而有關的申請籃子包括投資加基金單位持有人應佔資產淨值變動報表所呈列的相關現金成分。

#### (b) 贖回

於二零零八年十一月十四日之前，基金單位僅可以實物而不可以現金贖回。自二零零八年十一月十四日起，基金單位可(a)以實物換取申請籃子加現金成分贖回，或(b)以相當於申請籃子價值的現金數額加現金成分贖回。

於截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度/期間內，成分基金透過現金贖回及/或為換取申請籃子而贖回單位，而有關的申請籃子包括投資加基金單位持有人應佔資產淨值變動報表所呈列的相關現金成分。

### 9 非金錢佣金安排

管理人確認年內並無就將成分基金交易交由經紀商或交易商而作出非金錢佣金安排(二零一五年：無)。

### 10 證監會守則中的投資限制及禁止

根據證監會的跟蹤指數交易所買賣基金監管指引(「交易所買賣基金指引」)，管理人獲允許在成分基金中持有超出於相關指數中的相關比例，條件是於任何成分證券的超額投資持有量不得超過成分基金向證監會諮詢後合理釐定的最高限額。各成分基金的最高限額已於其各自的章程內披露。

管理人及信託人確認，所有成分基金於截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度/期間內符合此限制。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

證監會守則允許成分基金將成分基金資產淨值的10%以上投資於由單一發行人發行的成分證券，惟投資僅限於各自佔指數比重逾10%的成分證券，而成分基金就任何該等成分證券的持股量不可超過彼等各自於指數的比重(惟因指數構成產生變動及超出數額屬過渡及臨時性質所導致者除外)。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，下列成分基金持有個別佔成分基金資產淨值及其於相關指數的相應比重逾10%的成分證券：

### MSCI中國ETF

	於指數中的相應比重(%)		佔資產淨值百分比	
	二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 十二月三十一日	二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 十二月三十一日
騰訊控股有限公司	13.29	11.12	13.23	11.10

### 韓國綜合股價200ETF

	於指數中的相應比重(%)		佔資產淨值百分比	
	二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 十二月三十一日	二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 十二月三十一日
Samsung Electronics Co Ltd	26.25	不適用	25.94	不適用

### MSCI台灣ETF

	於指數中的相應比重(%)		佔資產淨值百分比	
	二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 十二月三十一日	二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 十二月三十一日
台灣積體電路製造股份有限公司	28.86	不適用	28.77	不適用

### 納斯達克100ETF

	於指數中的相應比重(%)		佔資產淨值百分比	
	二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 十二月三十一日	二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 十二月三十一日
Apple Inc	10.95	不適用	10.88	不適用

除上文所披露者外，截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，並無個別佔各成分基金資產淨值逾10%的其他證券。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

下表載列截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度／期間成分基金的每單位資產淨值及其相關指數的變動。

成分基金	相關指數	每單位 資產淨值的變動(%)		相關指數的變動(%)	
		二零一六年	二零一五年	二零一六年	二零一五年
MSCI 中國 ETF	MSCI 中國指數	0.34	(8.18)	0.94	(7.88)
MSCI 中國 A 股 ETF <sup>2</sup>	MSCI 中國 A 股國際指數	6.83	不適用	6.12	不適用
A50 中國 ETF	富時中國 A50 指數	(8.97)	(10.43)	(10.33)	(10.59)
SENSEX 印度 ETF	BSE SENSEX 指數	(0.01)	(9.04)	0.89	(8.15)
MSCI 亞洲 (日本除外)ETF	MSCI 綜合亞洲除日本指數 (於二零一五年 六月二十七日前： MSCI 亞洲 APEX 50 指數)	5.17	(8.10)	5.48	(7.20)
MSCI 亞洲新興市場 ETF	MSCI 新興亞洲指數	5.61	(10.66)	6.18	(9.85)
滬深 300 A 股 ETF	滬深 300 指數	(15.77)	0.34	(15.21)	0.79
韓國綜合股價 200 ETF <sup>3</sup>	KOSPI 200 淨總回報 美元指數	1.73	不適用	0.89	不適用
MSCI 台灣 ETF <sup>3</sup>	MSCI 台灣指數	9.31	不適用	9.57	不適用
DAX ETF <sup>4</sup>	德國 DAX 指數	11.82	不適用	11.93	不適用
歐元區 STOXX 50 ETF <sup>4</sup>	歐元區 STOXX 50 指數	8.79	不適用	8.93	不適用
富時 100 ETF <sup>4</sup>	富時 100 指數	14.46	不適用	14.63	不適用
納斯達克 100 ETF <sup>3</sup>	納斯達克 100 指數	10.73	不適用	10.91	不適用

<sup>2</sup> 此乃成分基金自成立以來的每單位資產淨值及其相關指數的變動。成分基金於二零一六年一月二十五日推出。

<sup>3</sup> 此乃成分基金自成立以來的每單位資產淨值及其相關指數的變動。成分基金於二零一六年六月二十二日推出。

<sup>4</sup> 此乃成分基金自成立以來的每單位資產淨值及其相關指數的變動。成分基金於二零一六年六月二十三日推出。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### 11 財務風險管理

成分基金的目標為提供在未扣除收費及開支前與各相關指數表現非常接近的投資回報。成分基金活動可能承受多項風險，包括但不限於與成分基金所投資市場相關的市場風險(包括市場價格風險、利率風險及貨幣風險)、信貸及交易對手風險及流動資金風險。

主要風險及風險管理政策概述如下。

#### (a) 市場風險

##### (i) 市場價格風險

市場價格風險指某金融工具的價值因市場價格變動(因利率風險或貨幣風險產生的變動除外)而波動的風險，無論該等變動是否因個別工具的特有因素或影響市場上所有工具的因素而引起。

成分基金為追蹤各自指數的表現而設，故成分基金面對的市場風險與所追蹤指數所面對者大致相同。管理人透過確保投資組合的主要特徵(例如證券比重及行業比重)與追蹤指數的特徵盡量吻合，以管理成分基金面對的市場風險。

截至十二月三十一日，成分基金按公平價值透過損益記賬的金融資產及金融負債集中在以下行業上：

##### (i) MSCI 中國 ETF

	截至二零一六年十二月三十一日		截至二零一五年十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
金融資產				
上市股本—以行業劃分				
航空與國防	2,016,379	0.14	4,391,579	0.18
航空運輸及物流	1,320,713	0.09	2,669,330	0.11
航空公司	2,911,343	0.20	7,481,740	0.31
機場服務	2,105,314	0.15	4,265,076	0.18
鋁	2,249,712	0.16	3,440,148	0.14
服裝、配飾及奢侈品	6,363,141	0.45	-	-
資產管理及託管銀行	6,576,753	0.47	8,521,544	0.35
汽車配件及設備	2,007,838	0.14	-	-
汽車製造商	29,571,345	2.10	56,050,246	2.33
生物技術	1,338,615	0.10	-	-
啤酒釀造	5,993,498	0.42	4,284,481	0.18

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	截至二零一六年十二月三十一日		截至二零一五年十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
煤及燃料消耗品	11,463,190	0.81	19,112,105	0.79
化學商品	2,614,021	0.19	3,669,054	0.15
通訊設備	1,645,638	0.12	4,535,344	0.19
電腦及電子零售	1,875,008	0.13	5,199,643	0.22
建築工程	19,856,852	1.41	37,479,365	1.55
建築機械與重型卡車	7,101,217	0.51	17,042,267	0.71
建築材料	6,241,170	0.45	12,373,022	0.51
銅	2,406,509	0.17	-	-
數據處理與外包服務	2,711,097	0.19	4,039,318	0.17
多元化銀行	245,252,144	17.40	465,519,043	19.30
多元化資本市場	2,530,336	0.18	5,621,319	0.23
各類金屬及採礦	-	-	4,109,024	0.17
各類房地產活動	1,899,638	0.14	13,375,337	0.55
教育服務	11,509,346	0.81	8,147,009	0.34
電子零件及設備	3,836,743	0.27	7,954,253	0.33
電子零件	4,177,955	0.30	-	-
電子製造服務	8,965,819	0.64	12,634,012	0.52
環境及設施服務	3,863,592	0.27	8,340,863	0.35
食品零售	-	-	6,865,976	0.28
鞋業	8,730,829	0.62	16,397,260	0.68
燃氣公用事業	11,017,976	0.79	24,179,953	1.00
黃金	2,570,730	0.18	3,977,334	0.17
醫療保健分銷商	8,845,773	0.63	16,518,699	0.68
醫療保健供應商	1,603,562	0.11	3,401,116	0.14
醫療保健技術	2,295,669	0.16	-	-
重型電力設備	1,744,751	0.12	3,943,389	0.16
公路及路軌	4,025,968	0.28	8,866,844	0.37

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	截至二零一六年十二月三十一日		截至二零一五年十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
家庭娛樂軟件	2,210,513	0.16	5,463,431	0.23
家用電器	2,732,824	0.19	6,710,538	0.28
超級市場及購物中心	2,889,728	0.21	4,735,844	0.20
獨立電力生產商及能源交易商	13,813,245	0.99	38,469,451	1.60
工業企業集團	18,312,528	1.30	40,739,404	1.69
工業用機械	5,063,988	0.36	12,410,350	0.52
綜合油氣	45,238,238	3.21	76,929,492	3.19
綜合電訊服務	20,310,099	1.44	43,264,690	1.79
互聯網及直銷零售	50,261,771	3.56	-	-
互聯網零售	-	-	43,753,594	1.81
互聯網軟件及服務	411,935,118	29.24	487,339,529	20.20
投資銀行及經紀	24,084,695	1.70	51,718,555	2.14
人壽及醫療保險	70,030,183	4.98	161,149,361	6.69
海運	-	-	6,868,439	0.28
港口航運及服務	6,338,965	0.45	15,764,978	0.65
電影及娛樂	2,578,182	0.18	6,588,883	0.27
綜合保險	12,112,368	0.86	28,557,677	1.18
油氣鑽井	2,326,039	0.17	4,100,296	0.17
油氣勘探及生產	29,836,075	2.12	56,494,424	2.34
油氣儲存及運輸	3,335,487	0.24	-	-
包裝食品及肉類	16,806,115	1.19	38,043,849	1.58
紙品	2,045,610	0.15	2,632,494	0.11
個人用品	7,255,715	0.52	18,247,808	0.76
醫藥	14,979,675	1.07	32,834,946	1.36
財產及意外保險	13,609,254	0.97	28,881,874	1.20
房地產發展	51,236,699	3.63	132,500,918	5.49
區域銀行	2,134,755	0.15	4,002,892	0.17

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	截至二零一六年十二月三十一日		截至二零一五年十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
可再生能源電力	5,217,908	0.37	9,441,820	0.39
餐廳	14,034,911	1.00	-	-
半導體設備	2,156,057	0.15	4,269,752	0.18
半導體	5,830,919	0.41	7,104,594	0.29
專項融資	2,392,949	0.17	4,351,797	0.18
技術硬件、存儲與外圍設備	6,001,923	0.43	17,804,687	0.74
紡織	-	-	8,451,937	0.35
貨車運輸	-	-	3,626,157	0.15
水公用事業	8,476,366	0.60	18,528,052	0.77
無線電訊服務	87,366,845	6.20	182,473,112	7.56
期貨				
H 股指數期貨	72,150	0.00	-	-
非上市供股權—以行業劃分				
半導體設備	-	-	29,446	0.00
	1,404,268,081	99.67	2,408,690,764	99.85
金融負債				
期貨				
H 股指數期貨	-	-	(44,400)	(0.00)
	-	-	(44,400)	(0.00)
	1,404,268,081	99.67	2,408,646,364	99.85

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，MSCI 中國 ETF 持有 MSCI 中國指數的所有成分股。因此，MSCI 中國 ETF 所面對的市場價格風險與 MSCI 中國指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動		對除稅後溢利的影響	
	二零一六年	二零一五年	二零一六年 百萬港元	二零一五年 百萬港元
MSCI 中國指數	±3%	±3%	±42	±72

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (ii) MSCI 中國 A 股 ETF

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 人民幣	佔資產淨值 百分比
金融資產		
上市股本—以行業劃分		
可選消費	7,234,689	10.96
主要消費	4,174,651	6.33
能源	1,824,406	2.78
金融	18,120,873	27.42
保健	4,534,821	6.87
工業	11,998,074	18.18
資訊科技	5,353,863	8.09
材料	5,551,096	8.37
房地產	3,944,830	5.95
電訊服務	611,116	0.92
公用事業	2,454,596	3.72
	65,803,015	99.59

截至二零一六年十二月三十一日，MSCI 中國 A 股 ETF 持有 MSCI 中國 A 股國際指數的所有成分股。因此，MSCI 中國 A 股 ETF 所面對的市場價格風險與 MSCI 中國 A 股國際指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動	對除稅後溢利的影響
	二零一六年	二零一六年 人民幣百萬元
MSCI 中國 A 股國際指數	±3%	±2

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (iii) A50 中國 ETF

	截至二零一六年十二月三十一日		截至二零一五年十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
<b>金融資產</b>				
<b>上市股本—以行業劃分</b>				
基本材料	-	-	193,440,474	0.45
可選消費	861,196,748	2.99	-	-
消費品	-	-	836,243,657	1.94
消費服務	-	-	154,406,244	0.36
主要消費	904,437,089	3.14	-	-
能源	436,598,117	1.52	-	-
金融	9,372,883,836	32.52	8,153,436,754	19.00
保健	67,115,394	0.23	56,787,528	0.13
工業	1,644,394,474	5.71	1,656,886,339	3.85
資訊科技	187,435,704	0.65	-	-
油氣	-	-	177,044,119	0.41
房地產	407,832,287	1.42	-	-
電訊	-	-	183,136,993	0.43
公用事業	516,115,734	1.79	244,600,249	0.56
	14,398,009,383	49.97	11,655,982,357	27.13
<b>CAAP—以行業劃分</b>				
基本材料	-	-	478,104,449	1.13
可選消費	661,324,049	2.26	-	-
消費品	-	-	2,249,091,186	5.24
消費服務	-	-	422,640,907	0.99
主要消費	998,457,743	3.48	-	-
能源	493,791,101	1.74	-	-
金融	9,703,248,262	33.69	20,570,483,070	47.87
保健	76,441,364	0.26	139,606,136	0.33
工業	1,688,702,833	5.87	4,341,248,530	10.10

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	截至二零一六年十二月三十一日		截至二零一五年十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
資訊科技	179,430,937	0.62	-	-
油氣	-	-	745,637,739	1.74
房地產	424,355,478	1.46	-	-
電訊	-	-	413,879,491	0.96
公用事業	105,418,771	0.36	580,556,386	1.34
	14,331,170,538	49.74	29,941,247,894	69.70
非上市指數掛鈎認股權證－以行業劃分				
富時中國A50指數	-	-	1,125,429,185	2.62
	-	-	1,125,429,185	2.62
	28,729,179,921	99.71	42,722,659,436	99.45

### (iii) A50 中國 ETF

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，A50 中國 ETF 包含了 50<sup>5</sup> 隻成分股，對比富時中國 A50 指數則有 50 隻成分股。因此，A50 中國 ETF 所面對的市場價格風險與富時中國 A50 指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動		對除稅後溢利的影響	
	二零一六年	二零一五年	二零一六年 百萬港元	二零一五年 百萬港元
富時中國A50指數	±3%	±3%	±862	±1,282

<sup>5</sup> A50 中國 ETF 持有構成富時中國 A50 指數的所有成分股(二零一五年：所有成分股)，其中 1 隻成分股(二零一五年：無)乃以上市股本直接持有，49 隻成分股(二零一五年：所有成分股)則以上市股本直接持有及透過 CAAP 間接持有。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (iv) SENSEX印度ETF

	截至二零一六年 十二月三十一日		截至二零一五年 十二月三十一日	
	公平價值 <sup>6</sup> 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 <sup>6</sup> 港元	佔資產淨值 百分比
<b>金融資產</b>				
上市股本—以行業劃分				
資本物品	43,121,275	5.39	50,242,132	6.07
金融	243,167,460	30.41	248,923,300	30.06
快速消費品	85,863,052	10.74	85,985,118	10.38
保健	55,558,956	6.95	71,791,377	8.67
資訊科技	116,771,571	14.6	133,517,187	16.12
金屬、金屬產品及採礦	34,132,114	4.27	34,552,204	4.17
油氣	81,954,499	10.25	79,889,434	9.65
電力	26,466,982	3.31	10,521,858	1.27
電訊	13,153,524	1.65	16,637,216	2.01
運輸設備	95,300,223	11.92	91,533,491	11.06
	795,489,656	99.49	823,593,317	99.46

SENSEX印度ETF透過毛里求斯附屬公司將所有或絕大部分資產投資在印度股本證券上，投資比重大致與BSE SENSEX指數股份的比重相同。因此，SENSEX印度ETF所面對的市場價格風險與BSE SENSEX指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動		對除稅後溢利的影響	
	二零一六年	二零一五年	二零一六年 百萬港元	二零一五年 百萬港元
BSE SENSEX指數	±3%	±3%	±24	±25

<sup>6</sup> 指毛里求斯附屬公司的數字。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (v) MSCI 亞洲(日本除外)ETF

	截至二零一六年 十二月三十一日		截至二零一五年 十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
金融資產				
上市股本—以行業劃分				
可選消費	346,007,428	8.22	6,927,544	7.58
主要消費	168,514,131	4.02	4,152,606	4.55
能源	141,754,855	3.36	2,890,423	3.12
金融	922,020,315	21.94	28,093,259	30.57
保健	61,208,524	1.43	1,390,236	1.50
工業	309,540,873	7.34	7,536,718	8.16
資訊科技	1,081,640,635	25.66	19,451,690	21.14
材料	159,350,592	3.78	3,371,856	3.66
房地產	246,676,528	5.85	-	-
電訊服務	217,581,540	5.17	5,452,001	5.91
公用事業	138,180,522	3.27	3,619,255	3.93
新加坡 MSCI 印度 ETF <sup>7</sup>	409,017,449	9.71	8,945,812	9.73
上市供股權—以行業劃分				
金融	-	-	1,741	0.00
非上市股本				
金融	1	0.00	-	-
非上市供股權—以行業劃分				
金融	-	-	109	0.00
資訊科技	-	-	368	0.00
	4,201,493,393	99.75	91,833,618	99.85

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	截至二零一六年 十二月三十一日		截至二零一五年 十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
<b>金融資產</b>				
<b>上市股本－以地域劃分</b>				
中國	1,522,428,896	36.14	27,824,082	30.25
香港	315,863,571	7.50	11,619,806	12.64
印度	409,017,449	9.71	8,945,812	9.73
印尼	136,607,759	3.24	2,718,467	2.96
馬來西亞	126,587,142	3.01	3,451,203	3.75
菲律賓	63,265,262	1.50	1,543,015	1.68
新加坡	178,498,634	4.24	4,662,524	5.07
南韓	721,089,232	17.12	16,292,053	17.71
台灣	608,967,818	14.46	12,673,101	13.78
泰國	119,167,629	2.83	2,101,337	2.28
<b>非上市股本－以地域劃分</b>				
馬來西亞	1	0.00	-	-
<b>上市供股權－以地域劃分</b>				
南韓	-	-	1,741	0.00
<b>非上市供股權－以地域劃分</b>				
中國	-	-	368	0.00
新加坡	-	-	109	0.00
	4,201,493,393	99.75	91,833,618	99.85

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，MSCI 亞洲(日本除外)ETF持有構成MSCI 綜合亞洲除日本指數的626隻成分股中625<sup>7</sup>隻成分股(二零一五年：625隻成分股中610<sup>7</sup>隻成分股)。因此，MSCI 亞洲(日本除外)ETF所面對的市場價格風險與MSCI 綜合亞洲除日本指數所面對者大致相同。

<sup>7</sup> 截至二零一六年十二月三十一日，於構成MSCI綜合亞洲除日本指數(於二零一五年六月二十七日：MSCI亞洲Apex 50指數)的626隻成分股(二零一五年：625隻成分股)中，MSCI亞洲(日本除外)ETF直接持有550隻成分股(二零一五年：537隻成分股)，及透過新加坡MSCI印度ETF間接持有75隻成分股(二零一五年：73隻成分股)。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

下表呈列截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動		對除稅後溢利的影響	
	二零一六年	二零一五年	二零一六年 百萬港元	二零一五年 百萬港元
MSCI 綜合亞洲除日本指數 (於二零一五年六月二十七日前： MSCI 亞洲 Apex 50 指數)	±3%	±3%	±126	±3

### (vi) MSCI 亞洲新興市場 ETF

	截至二零一六年 十二月三十一日		截至二零一五年 十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
金融資產				
上市股本 – 以行業劃分				
可選消費	9,859,136	8.27	9,884,875	8.09
主要消費	5,047,493	4.24	5,931,236	4.84
能源	4,633,810	3.89	4,421,033	3.62
金融	22,597,725	18.95	28,421,354	23.19
保健	2,169,798	1.82	2,086,186	1.69
工業	6,710,638	5.59	7,908,917	6.46
資訊科技	36,762,396	30.82	32,019,463	26.11
材料	5,710,469	4.80	5,953,171	4.86
房地產	2,227,172	1.87	-	-
電訊服務	6,296,952	5.29	7,593,184	6.21
公用事業	2,552,477	2.15	3,218,230	2.62
SENSEX 印度 ETF <sup>a</sup>	14,065,163	11.79	14,522,745	11.85
上市供股權 – 以行業劃分				
金融	-	-	2,954	0.00
非上市供股權 – 以行業劃分				
金融	-	-	-	-
資訊科技	-	-	493	0.00
上市認股權證 – 以行業劃分				
材料	-	-	1,168	0.00
	118,633,229	99.48	121,965,009	99.54

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	截至二零一六年 十二月三十一日		截至二零一五年 十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
<b>金融資產</b>				
<b>上市股本—以地域劃分</b>				
中國	45,568,819	38.21	45,688,392	37.29
印度	14,065,163	11.79	14,522,745	11.85
印尼	4,495,831	3.77	4,560,081	3.72
馬來西亞	3,790,625	3.18	4,306,887	3.52
菲律賓	2,114,725	1.78	2,553,201	2.08
南韓	24,745,834	20.75	26,689,432	21.78
台灣	19,996,792	16.77	20,359,088	16.62
泰國	3,855,440	3.23	3,280,568	2.68
<b>上市供股權—以地域劃分</b>				
南韓	-	-	2,954	0.00
<b>非上市供股權—以地域劃分</b>				
中國	-	-	493	0.00
台灣	-	-	-	-
<b>上市認股權證—以地域劃分</b>				
泰國	-	-	1,168	0.00
	118,633,229	99.48	121,965,009	99.54

截至二零一六年十二月三十一日，MSCI亞洲新興市場ETF持有構成MSCI新興亞洲指數的554隻成分股中418<sup>8</sup>隻成分股(二零一五年：554隻成分股中361<sup>8</sup>隻成分股)。MSCI亞洲新興市場ETF所面對的市場價格風險與MSCI新興亞洲指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動		對除稅後溢利的影響	
	二零一六年	二零一五年	二零一六年 百萬港元	二零一五年 百萬港元
MSCI新興亞洲指數	±3%	±3%	±4	±4

<sup>8</sup> 截至二零一六年十二月三十一日，於構成MSCI新興亞洲指數的554隻成分股(二零一五年：554隻成分股)中，MSCI亞洲新興市場ETF直接持有390隻成分股(二零一五年：333隻成分股)，及透過SENSEX印度ETF間接持有28隻成分股(二零一五年：28隻成分股)。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (vii) 滬深 300 A 股 ETF

	截至二零一六年 十二月三十一日		截至二零一五年 十二月三十一日	
	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比	公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
<b>金融資產</b>				
上市股本—以行業劃分				
可選消費	6,356,346	3.29	-	-
主要消費	8,926,123	4.61	-	-
能源	431,499	0.22	-	-
金融	2,993,476	1.55	-	-
保健	5,111,866	2.63	-	-
工業	14,587,069	7.54	-	-
資訊科技	5,712,330	2.96	-	-
材料	1,485,285	0.75	-	-
房地產	1,298,506	0.67	-	-
電訊服務	1,815,231	0.93	-	-
公用事業	581,935	0.30	-	-
	49,299,666	25.45	-	-
<b>CAAP—以行業劃分</b>				
可選消費	13,884,992	7.19	34,282,101	11.74
主要消費	2,771,599	1.41	18,066,240	6.17
能源	4,392,094	2.26	7,745,166	2.64
金融	65,598,212	33.87	116,615,803	39.90
保健	4,057,261	2.10	12,198,650	4.17
工業	16,262,175	8.38	47,292,340	16.15
資訊科技	10,923,290	5.65	23,256,173	7.97
材料	10,511,456	5.44	16,339,965	5.58
房地產	9,722,246	5.02	-	-
電訊服務	-	-	4,602,114	1.58
公用事業	5,038,368	2.59	11,924,760	4.04
	143,161,693	73.91	292,323,312	99.94
	192,461,359	99.36	292,323,312	99.94

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，滬深300 A股ETF持有298<sup>9</sup>隻成分股(二零一五年：所有成分股)，滬深300指數則有300隻成分股。滬深300 A股ETF所面對的市場價格風險與滬深300指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動		對除稅後溢利的影響	
	二零一六年	二零一五年	二零一六年 百萬港元	二零一五年 百萬港元
滬深300指數	±3%	±3%	±6	±9

### (viii) 韓國綜合股價200 ETF

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 美元	佔資產淨值 百分比
<b>金融資產</b>		
上市股本—以行業劃分		
可選消費	1,720,069	12.75
主要消費	1,031,729	7.63
能源	311,809	2.31
金融	1,730,706	12.86
保健	246,656	1.82
工業	1,469,854	10.92
資訊科技	4,863,463	36.07
材料	1,227,377	9.12
電訊服務	415,094	3.07
公用事業	293,259	2.17
	13,310,016	98.72

截至二零一六年十二月三十一日，韓國綜合股價200 ETF持有構成KOSPI 200淨總回報美元指數的200隻成分股中198隻成分股。因此，韓國綜合股價200 ETF所面對的市場價格風險與KOSPI 200淨總回報美元指數所面對者大致相同。

<sup>9</sup> 截至二零一六年十二月三十一日，滬深300 A股ETF持有構成滬深300指數的298隻成分股(二零一五年：所有成分股)，其中85隻成分股(二零一五年：無)乃以上市股本直接持有，159隻成分股(二零一五年：300隻成分股)透過CAAP間接持有及54隻成分股(二零一五年：無)則以上市股本直接持有及透過CAAP間接持有。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

下表呈列截至二零一六年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動	對除稅後溢利的影響
	二零一六年	二零一六年 百萬美元
KOSPI 200 淨總回報美元指數	±3%	±0.4

### (ix) MSCI 台灣 ETF

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 美元	佔資產淨值 百分比
<b>金融資產</b>		
上市股本—以行業劃分		
可選消費	781,608	3.94
主要消費	534,038	2.69
能源	160,596	0.81
金融	3,327,527	16.77
保健	73,329	0.37
工業	298,799	1.50
資訊科技	11,693,512	58.93
材料	1,933,914	9.76
房地產	85,071	0.43
電訊服務	879,511	4.44
	19,767,905	99.64

截至二零一六年十二月三十一日，MSCI 台灣 ETF 持有 MSCI 台灣指數的所有成分股。因此，MSCI 台灣 ETF 所面對的市場價格風險與 MSCI 台灣指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動	對除稅後溢利的影響
	二零一六年	二零一六年 百萬美元
MSCI 台灣指數	±3%	±0.6

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (x) DAX ETF

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 歐元	佔資產淨值 百分比
金融資產		
上市股本—以行業劃分		
可選消費	1,164,361	19.18
主要消費	179,509	2.96
金融	933,031	15.36
保健	918,690	15.13
工業	823,229	13.55
資訊科技	639,974	10.54
材料	861,806	14.19
房地產	85,143	1.40
電訊服務	335,801	5.53
公用事業	121,720	2.01
	6,063,264	99.85

截至二零一六年十二月三十一日，DAX ETF持有德國DAX指數的所有成分股。因此，DAX ETF所面對的市場價格風險與德國DAX指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動	對除稅後溢利的影響
	二零一六年	二零一六年 百萬歐元
德國DAX指數	±3%	±0.2

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (xi) 歐元區 STOXX 50 ETF

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 歐元	佔資產淨值 百分比
金融資產		
上市股本—以行業劃分		
可選消費	582,671	11.42
主要消費	546,519	10.71
能源	373,057	7.31
金融	1,100,685	21.58
保健	515,683	10.11
工業	720,367	14.12
資訊科技	338,672	6.64
材料	344,342	6.76
房地產	51,019	1.00
電訊服務	272,561	5.34
公用事業	232,953	4.57
	5,078,529	99.56

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 歐元	佔資產淨值 百分比
金融資產		
上市股本—以地域劃分		
比利時	166,511	3.26
芬蘭	61,071	1.20
法國	1,854,167	36.35
德國	1,708,787	33.50
愛爾蘭	62,746	1.23
意大利	244,160	4.79
荷蘭	471,546	9.24
西班牙	509,541	9.99
	5,078,529	99.56

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

截至二零一六年十二月三十一日，歐元區 STOXX 50 ETF 持有歐元區 STOXX 50 指數的所有成分股。因此，歐元區 STOXX 50 ETF 所面對的市場價格風險與歐元區 STOXX 50 指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動	對除稅後溢利的影響
	二零一六年	二零一六年 百萬歐元
歐元區 STOXX 50 指數	±3%	±0.2

### (xii) 富時 100 ETF

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 英鎊	佔資產淨值 百分比
<b>金融資產</b>		
上市股本—以行業劃分		
可選消費	362,038	9.07
主要消費	651,940	16.35
能源	620,041	15.54
金融	821,968	20.62
保健	422,305	10.58
工業	281,116	7.05
資訊科技	34,873	0.87
材料	370,566	9.29
房地產	46,343	1.16
電訊服務	185,043	4.64
公用事業	167,108	4.19
非上市股本—以行業劃分		
工業	313	0.01
	3,963,654	99.37

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 英鎊	佔資產淨值 百分比
金融資產		
上市股本－以地域劃分		
澳洲	84,490	2.12
智利	5,022	0.13
德國	11,444	0.29
愛爾蘭	122,629	3.07
約旦	5,452	0.14
馬里	14,049	0.35
墨西哥	4,396	0.11
荷蘭	410,600	10.29
南非	40,000	1.00
瑞士	106,471	2.67
英國	3,158,788	79.19
非上市股本－以地域劃分		
英國	313	0.01
	3,963,654	99.37

截至二零一六年十二月三十一日，富時 100 ETF 持有富時 100 指數的所有成分股。因此，富時 100 ETF 所面對的市場價格風險與富時 100 指數所面對者大致相同。

下表呈列截至二零一六年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動	對除稅後溢利的影響
	二零一六年	二零一六年 百萬英鎊
富時 100 指數	±3%	±0.1

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (xiii) 納斯達克 100 ETF

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 美元	佔資產淨值 百分比
金融資產		
上市股本—以行業劃分		
可選消費	1,676,090	21.37
主要消費	501,376	6.39
保健	901,380	11.50
工業	167,476	2.14
資訊科技	4,481,088	57.10
電訊服務	95,370	1.21
	7,822,780	99.71

	截至二零一六年十二月三十一日	
	公平價值 美元	佔資產淨值 百分比
金融資產		
上市股本—以地域劃分		
中國	138,658	1.77
愛爾蘭	15,573	0.20
以色列	20,101	0.26
荷蘭	46,653	0.59
新加坡	96,163	1.23
英國	77,017	0.98
美國	7,428,615	94.68
	7,822,780	99.71

截至二零一六年十二月三十一日，納斯達克 100 ETF 持有構成納斯達克 100 指數的 107 隻成分股中 106 隻成分股。因此，納斯達克 100 ETF 所面對的市場價格風險與納斯達克 100 指數所面對者大致相同。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

下表呈列截至二零一六年十二月三十一日在所有其他可變因素維持不變時，相關指數可能變動情況下的敏感度分析：

相關指數	可能合理變動	對除稅後溢利的影響
	二零一六年	二零一六年 百萬美元
納斯達克 100 指數	±3%	±0.2

### (II) 利率風險

利率風險由現行市場利率的波動對金融資產及負債的公平價值以及未來現金流量產生的影響而引致。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，所有成分基金的利率風險僅來自銀行結存(不時調整)。由於該等計息資產的短期性質使然，管理人認為倘市場利率變化，其公平價值及未來現金流量不會發生重大變化。因此並無就該等銀行結存披露敏感度分析。

### (III) 貨幣風險

#### MSCI 中國 ETF、A50 中國 ETF、SENSEX 印度 ETF、MSCI 亞洲(日本除外) ETF、MSCI 亞洲新興市場 ETF 及滬深 300 A 股 ETF

成分基金持有以其功能貨幣港元以外貨幣計值的資產及負債，因此承受與該等貨幣有關的貨幣風險。管理人認為成分基金所承受與港元掛鈎貨幣美元有關的貨幣風險甚微。

#### MSCI 中國 A 股 ETF

成分基金持有以其功能貨幣人民幣以外貨幣計值的資產及負債，因此承受與該等貨幣有關的貨幣風險。

#### 韓國綜合股價 200 ETF、MSCI 台灣 ETF 及納斯達克 100 ETF

成分基金持有以其功能貨幣美元以外貨幣計值的資產及負債，因此承受與該等貨幣有關的貨幣風險。管理人認為成分基金所承受與美元掛鈎貨幣港元有關的貨幣風險甚微。

#### DAX ETF 及歐元區 STOXX 50 ETF

成分基金持有以其功能貨幣歐元以外貨幣計值的資產及負債，因此承受與該等貨幣有關的貨幣風險。

#### 富時 100 ETF

成分基金持有以其功能貨幣英鎊以外貨幣計值的資產及負債，因此承受與該等貨幣有關的貨幣風險。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

(i) MSCI中國ETF

由於成分基金的資產及負債僅以港元及美元計值，故並無披露貨幣風險(二零一五年：無)。

(ii) MSCI中國A股ETF

成分基金承受與人民幣兌港元及美元有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以人民幣以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	港元 相等於人民幣	美元 相等於人民幣
— 貨幣	(8,992)	(13,619)
— 非貨幣	-	-

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與港元有關的相關匯率上升／下跌2%，而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	港元 相等於人民幣	美元 相等於人民幣
— 貨幣	(180)	(272)
— 非貨幣	-	-

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (iii) A50 中國 ETF

成分基金承受與港元兌人民幣有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以港元及美元以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

於二零一六年十二月三十一日	人民幣 相等於港元
— 貨幣	20,439,904
— 非貨幣	28,729,179,921

於二零一五年十二月三十一日	人民幣 相等於港元
— 貨幣	175,352,919
— 非貨幣	42,722,659,436

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與港元有關的相關匯率上升／下跌 2% (二零一五年：2%) 而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的最佳估計。

於二零一六年十二月三十一日	人民幣 相等於港元
— 貨幣	408,798
— 非貨幣	574,583,598

於二零一五年十二月三十一日	人民幣 相等於港元
— 貨幣	3,507,058
— 非貨幣	854,453,189

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (iv) SENSEX 印度 ETF<sup>10</sup>

成分基金承受與港元兌印度盧比(「印度盧比」)有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以港元及美元以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	印度盧比 相等於港元
— 貨幣	-
— 非貨幣	795,489,656

截至二零一五年十二月三十一日	印度盧比 相等於港元
— 貨幣	1
— 非貨幣	823,593,317

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與港元有關的相關匯率上升/下跌 2%(二零一五年: 2%)而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	印度盧比 相等於港元
— 貨幣	-
— 非貨幣	15,909,793

截至二零一五年十二月三十一日	印度盧比 相等於港元
— 貨幣	-
— 非貨幣	16,471,866

<sup>10</sup> 指毛里求斯附屬公司的數字。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (v) MSCI 亞洲(日本除外)ETF

成分基金承受與港元兌印尼盾(「印尼盾」)、韓圓(「韓圓」)、馬來西亞林吉特(「馬來西亞林吉特」)、菲律賓比索(「菲律賓比索」)、新加坡元(「新加坡元」)、泰銖(「泰銖」)及新台幣(「新台幣」)有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以港元及美元以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	印尼盾 相等於港元	韓圓 相等於港元	馬來西亞 林吉特 相等於港元	菲律賓比索 相等於港元	新加坡元 相等於港元	泰銖 相等於港元	新台幣 相等於港元
-貨幣	-	-	353,885	21,435	483,316	83,563	-
-非貨幣	133,157,122	721,089,232	126,587,143	61,338,381	186,684,356	119,167,630	608,967,818

截至二零一五年十二月三十一日	印尼盾 相等於港元	韓圓 相等於港元	馬來西亞 林吉特 相等於港元	菲律賓比索 相等於港元	新加坡元 相等於港元	泰銖 相等於港元	新台幣 相等於港元
-貨幣	-	49,481	9,944	881	22,985	1,745	-
-非貨幣	2,718,467	16,293,794	3,451,203	1,543,015	4,564,873	2,101,337	12,673,101

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與港元有關的相關匯率上升/下跌2%(二零一五年:2%)而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	印尼盾 相等於港元	韓圓 相等於港元	馬來西亞 林吉特 相等於港元	菲律賓比索 相等於港元	新加坡元 相等於港元	泰銖 相等於港元	新台幣 相等於港元
-貨幣	-	-	7,078	429	9,666	1,671	-
-非貨幣	2,663,142	14,421,785	2,531,743	1,226,768	3,733,687	2,383,353	12,179,356

截至二零一五年十二月三十一日	印尼盾 相等於港元	韓圓 相等於港元	馬來西亞 林吉特 相等於港元	菲律賓比索 相等於港元	新加坡元 相等於港元	泰銖 相等於港元	新台幣 相等於港元
-貨幣	-	989	199	18	460	35	-
-非貨幣	54,369	325,876	69,024	30,860	91,298	42,027	253,462

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (vi) MSCI 亞洲新興市場 ETF

成分基金承受與港元兌印尼盾、韓圓、馬來西亞林吉特、菲律賓比索、泰銖及新台幣有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以港元及美元以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	印尼盾 相等於港元	韓圓 相等於港元	馬來西亞 林吉特 相等於港元	菲律賓比索 相等於港元	泰銖 相等於港元	新台幣 相等於港元
-貨幣	-	-	13,107	941	6,093	-
-非貨幣	4,495,831	24,745,834	3,790,625	2,114,726	3,855,440	19,996,792

截至二零一五年十二月三十一日	印尼盾 相等於港元	韓圓 相等於港元	馬來西亞 林吉特 相等於港元	菲律賓比索 相等於港元	泰銖 相等於港元	新台幣 相等於港元
-貨幣	-	1,275	24,061	1,060	4,982	-
-非貨幣	4,560,081	26,692,386	4,306,887	2,553,201	3,281,736	20,359,088

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與港元有關的相關匯率上升/下跌2%(二零一五年:2%)而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	印尼盾 相等於港元	韓圓 相等於港元	馬來西亞 林吉特 相等於港元	菲律賓比索 相等於港元	泰銖 相等於港元	新台幣 相等於港元
-貨幣	-	-	262	19	122	-
-非貨幣	89,917	494,917	75,812	42,294	77,109	399,936

截至二零一五年十二月三十一日	印尼盾 相等於港元	韓圓 相等於港元	馬來西亞 林吉特 相等於港元	菲律賓比索 相等於港元	泰銖 相等於港元	新台幣 相等於港元
-貨幣	-	26	481	21	100	-
-非貨幣	91,201	533,848	86,138	51,064	65,635	407,182

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (vii) 滬深 300 A 股 ETF

成分基金承受與港元兌人民幣有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以港元及美元以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	人民幣 相等於港元
— 貨幣	1,927,853
— 非貨幣	192,461,359

截至二零一五年十二月三十一日	人民幣 相等於港元
— 貨幣	1,096
— 非貨幣	292,323,312

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與港元有關的相關匯率上升／下跌 2% (二零一五年：2%) 而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	人民幣 相等於港元
— 貨幣	38,557
— 非貨幣	3,849,227

截至二零一五年十二月三十一日	人民幣 相等於港元
— 貨幣	22
— 非貨幣	5,846,466

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (viii) 韓國綜合股價 200 ETF

成分基金承受與美元兌韓圓有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以港元及美元以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	韓圓 相等於美元
— 貨幣	157,541
— 非貨幣	13,310,016

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與美元有關的相關匯率上升／下跌 2% 而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	韓圓 相等於美元
— 貨幣	3,151
— 非貨幣	266,200

### (ix) MSCI 台灣 ETF

成分基金承受與美元兌新台幣有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以港元及美元以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	新台幣 相等於美元
— 貨幣	-
— 非貨幣	19,767,905

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與美元有關的相關匯率上升／下跌 2% 而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	新台幣 相等於美元
— 貨幣	-
— 非貨幣	395,358

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (x) DAX ETF

成分基金承受與歐元兌港元及美元有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以歐元以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	港元 相等於歐元	美元 相等於歐元
— 貨幣	(1,223)	(484)
— 非貨幣	-	-

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與歐元有關的相關匯率上升／下跌 2% 而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	港元 相等於歐元	美元 相等於歐元
— 貨幣	(24)	(10)
— 非貨幣	-	-

### (xi) 歐元區 STOXX 50 ETF

成分基金承受與歐元兌港元及美元有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以歐元以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	港元 相等於歐元	美元 相等於歐元
— 貨幣	(1,223)	(659)
— 非貨幣	-	-

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與歐元有關的相關匯率上升／下跌 2% 而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	港元 相等於歐元	美元 相等於歐元
— 貨幣	(25)	(13)
— 非貨幣	-	-

## 財務報表附註(續)

### (xii) 富時 100 ETF

成分基金承受與英鎊(「英鎊」)兌歐元、港元及美元有關的貨幣風險。

下表概述成分基金承受以英鎊以外貨幣計值的貨幣及非貨幣淨風險。

截至二零一六年十二月三十一日	歐元 相等於英鎊	港元 相等於英鎊	美元 相等於英鎊
— 貨幣	4,253	(1,044)	(271)
— 非貨幣	-	-	-

下表概述成分基金於十二月三十一日因匯率變動而波動的貨幣及非貨幣淨風險的敏感度。該分析乃基於與英鎊有關的相關匯率上升/下跌 2% 而所有其他可變因素維持不變的假設作出。此乃管理層對匯率可能產生的合理變動的最佳估計。

截至二零一六年十二月三十一日	歐元 相等於英鎊	港元 相等於英鎊	美元 相等於英鎊
— 貨幣	85	(21)	(5)
— 非貨幣	-	-	-

### (xiii) 納斯達克 100 ETF

由於成分基金的資產及負債僅以港元及美元計值，故並無披露貨幣風險。

## (b) 信貸及交易對手風險

信貸及交易對手風險指證券的發行人或交易的交易對手未能履行其與成分基金訂立的責任或承擔的風險。可能令成分基金承受信貸及交易對手集中風險的金融資產主要包括由 CAAP 發行人或 IAP 發行人作出的投資及銀行結存。

由二零一一年十月三十一日起，管理人須獲得至少佔各成分基金對各個別 CAAP 發行人所承擔的全部交易對手總風險的 100% 的抵押品，以確保沒有未獲抵押的交易對手風險。此外，當抵押品的性質為股票證券時，該股票抵押品的市場價值應至少佔所對應之全部交易對手風險的 120%。當抵押品的性質為非股票證券時，應採用謹慎的扣減政策。倘出現了管理人控制範圍以外的狀況而導致成分基金對 CAAP 發行人的風險無法符合完全抵押的情況，管理人將設法令有關額外抵押品在切實可行的情況下盡快交付予各成分基金，以遵守上述抵押要求。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

SENSEX 印度 ETF 可最多將其資產淨值的 15% 投資於 IAP，而於任何單一發行人的投資最多為其資產淨值的 10%。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，SENSEX 印度 ETF 並無持有任何 IAP。管理人透過與聲譽良好的高信貸評級經紀商、銀行及受監管交易所進行大部分投資交易及合約承擔活動，採取措施最大限度減低成分基金的交易對手風險。

所有上市投資交易均於交收時通過經批准且具信譽的經紀商結算或支付。因售出的投資只會在成分基金的託管人收取付款後方會交付，故拖欠付款的風險極小。購買證券時，當經紀商收到投資後隨即付款。倘任何一方未能履行其責任，交易將作廢。

截至十二月三十一日，相關 CAAP 發行人及標準普爾評級服務公司對其優先長期債務的信貸評級如下：

二零一六年		二零一五年	
CAAP 發行人	信貸評級	CAAP 發行人	信貸評級
Citigroup Global Markets Holdings Inc. <sup>11</sup>	BBB+	Barclays Bank PLC <sup>11</sup>	A-
Credit Suisse AG, Nassau Branch <sup>11,12</sup>	A	Citigroup Global Markets Holdings Inc. <sup>11</sup>	BBB+
HSBC Bank plc <sup>11,12</sup>	AA-	Credit Suisse AG, Nassau Branch <sup>11,12</sup>	A
JP Morgan Structured Products B.V. (由 JP Morgan Chase Bank, N.A. 提供擔保) <sup>11</sup>	A+	HSBC Bank plc <sup>11,12</sup>	AA-
Macquarie Bank Ltd <sup>11</sup>	A	JP Morgan Structured Products B.V. (由 JP Morgan Chase Bank, N.A. 提供擔保) <sup>11</sup>	A+
UBS AG London Branch <sup>11,12</sup>	A+	Macquarie Bank Ltd <sup>11</sup>	A
		UBS AG London Branch <sup>11,12</sup>	A

CAAP 發行人包括信託人的關連人士。

<sup>11</sup> 適用於 A50 中國 ETF

<sup>12</sup> 適用於滬深 300 A 股 ETF

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

- (i) MSCI中國ETF、MSCI中國A股ETF、SENSEX印度ETF、MSCI亞洲(日本除外)ETF、MSCI亞洲新興市場ETF、韓國綜合股價200ETF、MSCI台灣ETF、DAXETF、歐元區STOXX50ETF、富時100ETF及納斯達克100ETF

下表分別載列成分基金截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日的交易對手淨風險，以及標準普爾評級服務公司對該等交易對手優先長期債務的信貸評級：

	iShares安碩MSCI中國指數ETF		iShares安碩核心MSCI亞洲 (日本除外)指數ETF (前稱iShares安碩MSCI亞洲 (日本除外)指數ETF)	
	二零一六年 交易對手 淨風險 港元	二零一五年 交易對手 淨風險 港元	二零一六年 交易對手 淨風險 港元	二零一五年 交易對手 淨風險 港元
<b>應收經紀商款項</b>				
–JPMorgan Chase & Co	4,763,145	不適用	不適用	不適用
評級	A-	不適用	不適用	不適用
–Goldman Sachs International (由Goldman Sachs Group, Inc. 提供擔保)	不適用	不適用	不適用	72,682
評級	不適用	不適用	不適用	BBB+
–Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Inc	55,857	不適用	不適用	不適用
評級	A+	不適用	不適用	不適用
<b>保證金存款</b>				
–Credit Suisse International	175,847	152,400	不適用	不適用
評級	A	A	不適用	不適用

於報告期末所承受的最大信貸風險為資產的賬面值(如財務狀況報表所示)。

成分基金亦承受託管人所持資產的信貸及交易對手風險。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，成分基金所有銀行結存均存放於香港上海滙豐銀行有限公司，標準普爾評級服務公司對其優先長期債務給予信貸評級AA-(二零一五年：AA-)。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，所有投資均存放於滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司，標準普爾評級服務公司對其優先長期債務給予信貸評級AA-(二零一五年：AA-)。

管理人認為，截至二零一六年十二月三十一日，該等資產概無減值或過期(二零一五年：無)。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### (ii) A50 中國 ETF 及滬深 300 A 股 ETF

成分基金須承受與各 CAAP 發行人有關的信貸及交易對手風險，倘 CAAP 發行人未能履行其於 CAAP 項下之責任，該等成分基金亦可能會蒙受與 CAAP 發行人所發行 CAAP 的全部價值相等之潛在虧損。CAAP 構成 CAAP 發行人的直接、一般及無抵押合約責任。

管理人透過與多個 CAAP 發行人交易以降低與成分基金有關的交易對手風險。此外，自二零一一年十月三十一日起，管理人已分別與 CAAP 發行人或其聯屬公司，即 Barclays Bank PLC、Citigroup Global Markets Limited(「Citigroup」)、CLSA Limited、Credit Suisse Securities (Europe) Limited(「Credit Suisse」)、Goldman Sachs International、HSBC Bank plc、ING Bank N.V.、J.P. Morgan Securities plc、Macquarie Bank Ltd、Merrill Lynch International、Morgan Stanley & Co. International Plc、Nomura International plc、渣打銀行、The Royal Bank of Scotland PLC 及 UBS AG London Branch 訂立借出證券安排，以將成分基金對各 CAAP 發行人的交易對手風險全部抵押。根據借出證券安排，CAAP 發行人已同意就已發行的 CAAP 向成分基金提供股份、固定收入或現金抵押品。成分基金將向 CAAP 發行人借出 CAAP，並就此收取股份、固定收入或現金抵押品。借出證券安排旨在將成分基金對各 CAAP 發行人的交易對手風險全部抵押。

抵押品及 CAAP 每日由借方或借方的聯屬公司使用最新買賣價格按市值計價。管理人可要求額外抵押品，以彌補任何抵押不足。同樣，借方亦可要求退還抵押品，以抵銷任何多餘的抵押。

下表概述截至十二月三十一日成分基金所持抵押品的公平價值：

	iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF* (* 此基金為一隻合成交易所買賣基金)		iShares 安碩滬深 300 A 股指數 ETF* (* 此基金為一隻合成交易所買賣基金)	
	二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
抵押品價值	15,856,706,626	35,827,853,321	163,731,067	358,879,204

成分基金就抵押安排支付費用。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，根據借出證券安排產生的費用披露於全面收入報表。

根據借出證券安排，貸方及借方均有責任支付及交付原擁有人應享有的任何款額或財產，包括股息及利息。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

抵押品可能涉及的風險包括結算、營運及變現風險。例如，抵押品的市值或會波動，有關證券的價格可升可跌。抵押證券的價值於變現時可能下降。如抵押證券為上市證券，則該等證券的上市地位可能被暫停或撤銷，或該等證券在證券交易所的買賣可能會暫停，而在停牌期間或被撤銷上市地位後，可能無法將有關抵押證券變現。雖然管理人將致力就任何抵押品使用具有稅務效益的安排，但不保證該項安排不會受到稅務機關的質疑。如該等安排不獲通過，則成分基金或須支付必需的稅項(如印花稅等)及其他罰款。

因此，所變現抵押品的價值可能不足以彌補該抵押品所擔保的CAAP的價值。就A50中國ETF而言，於二零一六年十二月三十一日的所有抵押品不足已由管理人於二零一七年一月三日要求的額外抵押品全部補足(二零一五年：無)。就滬深300 A股ETF而言，於二零一六年及二零一五年十二月三十一日並不存在抵押品不足。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，成分基金與其唯一衍生交易對手訂立總淨額結算安排。成分基金的所有衍生資產均由該等交易對手持有。

下表呈列成分基金受抵銷、強制總淨額結算安排及類似協議規限的金融資產。下表乃按金融工具類型呈列。

	已確認金融資產總額 港元	於財務狀況報表 抵銷的已確認 金融負債總額 港元	於財務狀況報表 呈列的 金融資產淨額 港元	未於財務狀況報表抵銷的有關金額		淨額 港元
				金融工具 港元	抵押品 港元	
<b>A50 中國ETF</b>						
二零一六年 十二月三十一日						
CAAP	28,729,179,921	-	28,729,179,921	14,398,009,383 <sup>13</sup>	14,331,170,538	-
二零一五年 十二月三十一日						
CAAP	42,722,659,436	-	42,722,659,436	12,781,411,542 <sup>14</sup>	29,941,247,894	-
<b>滬深300 A股ETF</b>						
二零一六年 十二月三十一日						
CAAP	192,461,359	-	192,461,359	49,299,666 <sup>13</sup>	143,161,693	-
二零一五年 十二月三十一日						
CAAP	292,323,312	-	292,323,312	-	292,323,312	-

<sup>13</sup> 指截至二零一六年十二月三十一日的直接A股投資。

<sup>14</sup> 指截至二零一五年十二月三十一日的直接A股及指數掛鈎認股權證投資。

## 財務報表附註(續)

於報告期末所承受的最大信貸風險為資產的賬面值(如財務狀況報表所示)。

管理人認為，截至二零一六年十二月三十一日，該等資產概無減值或過期(二零一五年：無)。

成分基金亦承受託管人所持資產的信貸及交易對手風險。

就滬深300 A股ETF而言，截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，所有銀行結存均存放於香港上海滙豐銀行有限公司，標準普爾評級服務公司對其優先長期債務給予信貸評級AA-(二零一五年：AA-)。

就A50中國ETF而言，截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，124,048,147港元(二零一五年：651,831,415港元)及10,322,686港元(二零一五年：160,166,895港元)的銀行結存分別存放於香港上海滙豐銀行有限公司及Citibank, N.A.，標普對其優先長期債務分別給予信貸評級AA-及A+(二零一五年：分別為AA-及A)。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，A50中國ETF的所有直接A股投資均存放於花旗銀行(中國)有限公司，標準普爾評級服務公司對花旗銀行(中國)有限公司的母公司Citibank, N.A.給予信貸評級A+(二零一五年：A)。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，成分基金的所有投資(根據借出證券安排借予CAAP發行人的CAAP除外)均存放於滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司，標準普爾評級服務公司對其優先長期債務給予信貸評級AA-(二零一五年：AA-)。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，成分基金根據借出證券安排收取的抵押品均存放於獲標準普爾評級服務公司對其優先長期債務給予信貸評級介乎AA-至A(二零一五年：A至BBB+)的第三方銀行及託管人。

### (c) 流動資金風險

流動資金風險指成分基金或不能於到期時產生充足現金資源以完全履行其責任，或只能按重大不利的條款履行其責任的風險。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，各成分基金的所有財務負債均於十二個月內到期，由於折現影響不大，故相等於其賬面結餘。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，各成分基金持有財務狀況報表所述的預期可隨時產生現金流入(一般於一個月內)以管理流動資金風險的按公平價值透過損益記賬的金融資產及其他流動資產。

MSCI中國ETF、MSCI中國A股ETF、MSCI亞洲(日本除外)ETF、MSCI亞洲新興市場ETF、韓國綜合股價200ETF、MSCI台灣ETF、DAXETF、歐元區STOXX50ETF、富時100ETF及納斯達克100ETF均將其大部分資產投資於在活躍市場買賣及可隨時出售的投資。

A50中國ETF及滬深300A股ETF持有並無在活躍市場進行買賣的CAAP。然而，與參與證券商的交易通常以實物方式進行，倘參與證券商以現金認購或贖回基金單位，則有關交易將透過由參與證券商提名的CAAP發行人進行。

## 財務報表附註(續)

SENSEX印度ETF透過毛里求斯附屬公司將其大部分資產投資於在活躍市場買賣及可隨時出售的投資，惟可持有並無活躍市場進行買賣的IAP最多為其資產淨值的15%。然而，倘參與證券商以現金認購或贖回基金單位，則有關交易將透過由參與證券商提名的IAP發行人進行。截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，SENSEX印度ETF並無持有任何IAP。

### (d) 公平價值估計

於活躍市場買賣的投資(如公開買賣的衍生工具及交易證券)的公平價值乃按於報告日期所報收市價釐定。於交易所上市或買賣的投資按最後成交價計量公平價值。

活躍市場指資產或負債的交易次數及交易量足以按持續基準提供定價資料的市場。

截至二零一六年十二月三十一日，100%(二零一五年：100%)按公平價值透過損益記賬的金融資產與SENSEX印度ETF於毛里求斯附屬公司的投資有關。有關投資乃按附註2(d)所載政策計量公平價值。毛里求斯附屬公司的股份並非公開買賣；如發售文件所訂明，SENSEX印度ETF僅可於贖回日期進行有關贖回。因此，毛里求斯附屬公司的賬面值未必表示贖回時的最終變現價值。

於毛里求斯附屬公司投資的公平價值主要根據毛里求斯附屬公司的管理人所呈報參與股份的最新資產淨值計量。SENSEX印度ETF可根據其於毛里求斯附屬公司持股量的流動性或其相關投資等考量因素對價值加以調整。

國際財務準則第13號要求成分基金使用公平價值等級對其公平價值計量進行分類。有關等級可反映計量所用輸入數據的重要性。公平價值等級共有以下等級：

- 就相同資產或負債，實體在計量日能獲得的活躍市場報價(未經調整)(第一級)。
- 不包括於第一級內報價，資產或負債可直接或間接觀察的輸入數據(第二級)。
- 資產或負債屬不可觀察的輸入數據(第三級)。

整體公平價值計量在公平價值等級的分類取決於對整體公平價值計量而言屬重要的輸入數據的最低等級。就此而言，輸入數據的重要性根據整體公平價值計量進行評估。倘公平價值計量使用的可觀察輸入數據須根據不可觀察輸入數據進行重大調整，則該計量為第三級計量。評估整體公平價值計量的特定輸入數據的重要性需要作出判斷，考慮資產或負債的特定因素。

釐定何為「可觀察」須管理人作出重大判斷。管理人認為可觀察數據為容易獲取、定期分發或更新、可靠及可被核實、非專屬及由活躍參與相關市場的獨立來源所提供的市場數據。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

下表分析於公平價值等級中成分基金於十二月三十一日按公平價值計量的按公平價值透過損益記賬的金融資產(按類別)：

MSCI 中國 ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元	總計 港元
二零一六年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬的 金融資產				
— 股本證券	1,404,195,897	-	34	1,404,195,931
— 期貨	72,150	-	-	72,150
總資產	1,404,268,047	-	34	1,404,268,081

MSCI 中國 ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元	總計 港元
二零一五年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬的 金融資產				
— 股本證券	2,398,438,003	-	10,223,315	2,408,661,318
— 非上市供股權	-	29,446	-	29,446
總資產	2,398,438,003	29,446	10,223,315	2,408,690,764
負債				
按公平價值透過損益記賬的 金融負債				
— 期貨	44,400	-	-	44,400
總負債	44,400	-	-	44,400

MSCI 中國 A 股 ETF	第一級 人民幣	第二級 人民幣	第三級 人民幣	總計 人民幣
二零一六年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬的 金融資產				
— 股本證券	62,840,779	1,696,619	1,265,617	65,803,015
總資產	62,840,779	1,696,619	1,265,617	65,803,015

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元	總計 港元
<b>A50 中國 ETF</b>				
二零一六年十二月三十一日				
<b>資產</b>				
按公平價值透過損益記賬的 金融資產				
— 股本證券	14,265,909,246	132,100,137	-	14,398,009,383
— CAAP	-	14,331,170,538	-	14,331,170,538
<b>總資產</b>	<b>14,265,909,246</b>	<b>14,463,270,675</b>	<b>-</b>	<b>28,729,179,921</b>
二零一五年十二月三十一日				
<b>資產</b>				
按公平價值透過損益記賬的金融 資產				
— 股本證券	10,874,029,402	-	781,952,955	11,655,982,357
— CAAP	-	28,438,808,787	1,502,439,107	29,941,247,894
— 非上市指數掛鈎認股權證	-	1,125,429,185	-	1,125,429,185
<b>總資產</b>	<b>10,874,029,402</b>	<b>29,564,237,972</b>	<b>2,284,392,062</b>	<b>42,722,659,436</b>
<b>SENSEX 印度 ETF</b>				
二零一六年十二月三十一日				
<b>資產</b>				
按公平價值透過損益記賬的 金融資產				
— 投資基金	-	797,797,824	-	797,797,824
<b>總資產</b>	<b>-</b>	<b>797,797,824</b>	<b>-</b>	<b>797,797,824</b>
二零一五年十二月三十一日				
<b>資產</b>				
按公平價值透過損益記賬的 金融資產				
— 投資基金	-	826,151,554	-	826,151,554
<b>總資產</b>	<b>-</b>	<b>826,151,554</b>	<b>-</b>	<b>826,151,554</b>

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

MSCI 亞洲(日本除外)ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元	總計 港元
<b>二零一六年十二月三十一日</b>				
<b>資產</b>				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	4,200,054,409	1,438,983	-	4,201,493,392
— 非上市股本	-	-	1	1
<b>總資產</b>	<b>4,200,054,409</b>	<b>1,438,983</b>	<b>1</b>	<b>4,201,493,393</b>
<b>二零一五年十二月三十一日</b>				
<b>資產</b>				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	91,705,450	-	125,950	91,831,400
— 上市供股權	1,741	-	-	1,741
— 非上市供股權	-	477	-	477
<b>總資產</b>	<b>91,707,191</b>	<b>477</b>	<b>125,950</b>	<b>91,833,618</b>
<b>MSCI 亞洲新興市場ETF</b>	<b>第一級 港元</b>	<b>第二級 港元</b>	<b>第三級 港元</b>	<b>總計 港元</b>
<b>二零一六年十二月三十一日</b>				
<b>資產</b>				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	118,543,218	90,010	1	118,633,229
<b>總資產</b>	<b>118,543,218</b>	<b>90,010</b>	<b>1</b>	<b>118,633,229</b>
<b>二零一五年十二月三十一日</b>				
<b>資產</b>				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	121,777,193	-	183,201	121,960,394
— 上市供股權	2,954	-	-	2,954
— 非上市供股權	-	493	-	493
— 上市認股權證	1,168	-	-	1,168
<b>總資產</b>	<b>121,781,315</b>	<b>493</b>	<b>183,201</b>	<b>121,965,009</b>

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

滬深300 A股ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元	總計 港元
二零一六年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	48,142,891	1,156,775	-	49,299,666
— CAAP	-	142,948,007	213,686	143,161,693
<b>總資產</b>	<b>48,142,891</b>	<b>144,104,782</b>	<b>213,686</b>	<b>192,461,359</b>
二零一五年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— CAAP	-	275,493,990	16,829,322	292,323,312
<b>總資產</b>	<b>-</b>	<b>275,493,990</b>	<b>16,829,322</b>	<b>292,323,312</b>
韓國綜合股價200 ETF	第一級 美元	第二級 美元	第三級 美元	總計 美元
二零一六年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	13,258,094	42,241	9,681	13,310,016
<b>總資產</b>	<b>13,258,094</b>	<b>42,241</b>	<b>9,681</b>	<b>13,310,016</b>
MSCI 台灣ETF	第一級 美元	第二級 美元	第三級 美元	總計 美元
二零一六年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	19,767,905	-	-	19,767,905
<b>總資產</b>	<b>19,767,905</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>19,767,905</b>

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

DAX ETF	第一級 歐元	第二級 歐元	第三級 歐元	總計 歐元
二零一六年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	6,063,264	-	-	6,063,264
<b>總資產</b>	<b>6,063,264</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6,063,264</b>
歐元區 STOXX 50 ETF	第一級 歐元	第二級 歐元	第三級 歐元	總計 歐元
二零一六年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	5,078,529	-	-	5,078,529
<b>總資產</b>	<b>5,078,529</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5,078,529</b>
富時 100 ETF	第一級 英鎊	第二級 英鎊	第三級 英鎊	總計 英鎊
二零一六年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	3,963,341	-	-	3,963,341
— 非上市股本	-	-	313	313
<b>總資產</b>	<b>3,963,341</b>	<b>-</b>	<b>313</b>	<b>3,963,654</b>
納斯達克 100 ETF	第一級 美元	第二級 美元	第三級 美元	總計 美元
二零一六年十二月三十一日				
資產				
按公平價值透過損益記賬 的金融資產				
— 股本證券	7,822,780	-	-	7,822,780
<b>總資產</b>	<b>7,822,780</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>7,822,780</b>

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

根據活躍市場所報市價計算價值的投資分類為第一級。成分基金並無就該等工具調整報價。

於不被視為活躍的市場中買賣但根據市場報價、交易商報價或其他由可觀察輸入數據支持的定價來源估值的投資分類為第二級。成分基金第二級投資主要為 CAAP、暫停買賣的股本證券及非上市供股權。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，SENSEX 印度 ETF 將其於毛里求斯附屬公司的投資分類為公平價值等級第二級，原因是管理人認為 SENSEX 印度 ETF 可能已於財務狀況報表日期按每股資產淨值贖回其投資。有關投資乃使用毛里求斯附屬公司行政管理人所呈報的資產淨值按公平價值計量。

分類為第三級的投資由於買賣淡靜，故不可觀察輸入數據屬重大。截至二零一六年十二月三十一日，第三級投資包括由 MSCI 中國 ETF、MSCI 中國 A 股 ETF、MSCI 亞洲(日本除外)ETF、MSCI 亞洲新興市場 ETF、韓國綜合股價 200 ETF 及富時 100 ETF 持有的股本證券，該等股本證券使用外部定價資源定價，現暫停買賣為非上市股本。由滬深 300 A 股 ETF 持有的第三級投資指相關股本證券暫停買賣的 CAAP。第三級估值乃由管理人的估值委員會每月檢討，該委員會評估投資估值的適當性。

下表呈列截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日成分基金所持第三級投資的敏感度分析。

### MSCI 中國 ETF

並無呈列 MSCI 中國 ETF 截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日所持第三級投資的敏感度分析，原因是輸入數據合理變動的影響被視作並不重大。

### MSCI 中國 A 股 ETF

並無呈列 MSCI 中國 A 股 ETF 截至二零一六年十二月三十一日所持第三級投資的敏感度分析，原因是輸入數據合理變動的影響被視作並不重大。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### A50 中國 ETF

截至二零一六年十二月三十一日，A50 中國 ETF 並無持有任何第三級投資。

截至二零一五年十二月三十一日，第三級投資包括由 A50 中國 ETF 持有的若干非流動股本證券及非流動 CAAP。

截至二零一五年十二月三十一日	公平價值 港元	估值技術	不可觀察 輸入數據	加權平均 輸入數據	合理可能變動 +/(絕對值)	估值變動 港元
股本證券						
—金融	781,952,955	第三方交易商或賣方之估值	不適用	不適用	不適用	不適用
CAAP						
—金融	1,502,439,107	第三方交易商或賣方之估值	不適用	不適用	不適用	不適用

### MSCI 亞洲(日本除外)ETF

並無呈列 MSCI 亞洲(日本除外)ETF 截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日所持第三級投資的敏感度分析，原因是輸入數據合理變動的影響被視作並不重大。

### MSCI 亞洲新興市場 ETF

並無呈列 MSCI 亞洲新興市場 ETF 截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日所持第三級投資的敏感度分析，原因是輸入數據合理變動的影響被視作並不重大。

### 滬深 300 A 股 ETF

並無呈列滬深 300 A 股 ETF 截至二零一六年十二月三十一日所持第三級投資的敏感度分析，原因是輸入數據合理變動的影響被視作並不重大。截至二零一五年十二月三十一日，第三級投資包括若干不流動 CAAP，由滬深 300 A 股 ETF 持有。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

截至二零一五年十二月三十一日	公平價值 港元	估值技術	不可觀察 輸入數據	加權平均 輸入數據	合理可能變動 +/(絕對值)	估值變動 港元
CAAP						
—可選消費	1,007,685	第三方交易商或賣方之估值	不適用	不適用	不適用	不適用
—主要消費	923,093	第三方交易商或賣方之估值	不適用	不適用	不適用	不適用
—公用事業	278,679	第三方交易商或賣方之估值	不適用	不適用	不適用	不適用
—資訊科技	3,432,773	第三方交易商或賣方之估值	不適用	不適用	不適用	不適用
—工業	1,697,883	第三方交易商或賣方之估值	不適用	不適用	不適用	不適用
—金融	8,682,754	第三方交易商或賣方之估值	不適用	不適用	不適用	不適用
—電訊服務	806,455	第三方交易商或賣方之估值	不適用	不適用	不適用	不適用

### 韓國綜合股價200 ETF

並無呈列韓國綜合股價200 ETF截至二零一六年十二月三十一日所持第三級投資的敏感度分析，原因是輸入數據合理變動的影響被視作並不重大。

### 富時100 ETF

並無呈列富時100 ETF截至二零一六年十二月三十一日所持第三級投資的敏感度分析，原因是輸入數據合理變動的影響被視作並不重大。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，成分基金所持各級投資之間並無轉移，惟下述者除外。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

下表載列截至二零一六年十二月三十一日止年度所持各級投資之間的轉移：

MSCI 中國 ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
從第三級轉移至第一級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
房地產開發	3,319,546	-	(3,319,546)
	3,319,546	-	(3,319,546)

從第三級轉移至第一級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日買賣活躍的證券，但於二零一五年十二月三十一日已暫停買賣。

MSCI 中國 A 股 ETF	第一級 人民幣	第二級 人民幣	第三級 人民幣
從第一級轉移至第三級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
可選消費	(164,200)	-	164,200
金融	(69,564)	-	69,564
工業	(422,275)	-	422,275
資訊科技	(448,378)	-	448,378
原材料	(161,200)	-	161,200
	(1,265,617)	-	1,265,617

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

MSCI 中國 A 股 ETF	第一級 人民幣	第二級 人民幣	第三級 人民幣
從第一級轉移至第二級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
可選消費	(230,409)	230,409	-
金融	(494,348)	494,348	-
保健	(43,340)	43,340	-
工業	(198,592)	198,592	-
資訊科技	(271,245)	271,245	-
原材料	(132,111)	132,111	-
房地產	(326,574)	326,574	-
	(1,696,619)	1,696,619	-

從第一級轉移至第三級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣兩個月以上的證券。從第一級轉移至第二級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣兩個月或以內的證券。

A50 中國 ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
從第一級轉移至第二級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
金融	(132,100,137)	132,100,137	-
	(132,100,137)	132,100,137	-

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

從第一級轉移至第二級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣但於二零一五年十二月三十一日買賣活躍的證券。

MSCI 亞洲(日本除外)ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
<b>從第一級轉移至第三級：</b>			
<b>資產</b>			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
金融	(1)	-	1
	(1)	-	1
<b>從第一級轉移至第二級：</b>			
<b>資產</b>			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
金融	(1,438,983)	1,438,983	-
	(1,438,983)	1,438,983	-

從第一級轉移至第三級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣兩個月以上但於二零一五年十二月三十一日買賣活躍的證券。從第一級轉移至第二級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣兩個月或以內但於二零一五年十二月三十一日買賣活躍的證券。

MSCI 亞洲新興市場ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
<b>從第一級轉移至第二級：</b>			
<b>資產</b>			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
金融	(90,010)	90,010	-
	(90,010)	90,010	-

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

MSCI 亞洲新興市場 ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
從第三級轉移至第一級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
房地產	132,750	-	(132,750)
	132,750	-	(132,750)

從第一級轉移至第二級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣兩個月或以內但於二零一五年十二月三十一日買賣活躍的證券。從第三級轉移至第一級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日買賣活躍但於二零一五年十二月三十一日暫停買賣的證券。

滬深300 A股 ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
從第一級轉移至第二級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
金融	(325,743)	325,743	-
工業	(149,592)	149,592	-
資訊科技	(681,440)	681,440	-
	(1,156,775)	1,156,775	-
從第二級轉移至第三級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— CAAP			
工業	-	(104,958)	104,958
資訊科技	-	(108,728)	108,728
	-	(213,686)	213,686

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

滬深300 A股ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
從第三級轉移至第二級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
—CAAP			
主要消費	-	344,398	(344,398)
金融	-	720,759	(720,759)
資訊科技	-	1,392,405	(1,392,405)
房地產	-	3,637,930	(3,637,930)
公用事業	-	235,473	(235,473)
	-	6,330,965	(6,330,965)

從第一級轉移至第二級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣兩個月或以內但於二零一五年十二月三十一日買賣活躍的證券。從第二級轉移至第三級的CAAP為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣兩個月以上但於二零一五年十二月三十一日買賣活躍的相關證券。從第三級轉移至第二級的CAAP為於二零一六年十二月三十一日買賣活躍但於二零一五年十二月三十一日暫停買賣的相關證券。

韓國綜合股價200ETF	第一級 美元	第二級 美元	第三級 美元
從第一級轉移至第三級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
—股本證券			
工業	(9,681)	-	9,681
	(9,681)	-	9,681
從第一級轉移至第二級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
—股本證券			
保健	(14,083)	14,083	-
金融	(28,158)	28,158	-
	(42,241)	42,241	-

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

從第一級轉移至第三級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣兩個月以上的證券。從第一級轉移至第二級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日暫停買賣兩個月或以內的證券。

富時 100ETF	第一級 英鎊	第二級 英鎊	第三級 英鎊
從第一級轉移至第三級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
工業	(313)	-	313
	(313)	-	313

從第一級轉移至第三級的股本證券為於二零一六年十二月三十一日並無上市之證券。

下表載列截至二零一五年十二月三十一日止年度所持各級投資之間的轉移：

MSCI 中國ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
從第一級轉移至第三級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
半導體設備	(45)	-	45
房地產開發	(10,223,270)	-	10,223,270
	(10,223,315)	-	10,223,315

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

從第一級轉移至第三級的股本證券為於二零一五年十二月三十一日暫停買賣以上但於二零一四年十二月三十一日買賣活躍的證券。

A50 中國 ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
<b>從第一級轉移至第三級：</b>			
<b>資產</b>			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
金融	(781,952,955)	-	781,952,955
	(781,952,955)	-	781,952,955
<b>從第二級轉移至第三級：</b>			
<b>資產</b>			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— CAAP			
金融	-	(1,502,439,107)	1,502,439,107
	-	(1,502,439,107)	1,502,439,107

從第一級轉移至第三級的股本證券為於二零一五年十二月三十一日暫停買賣但於二零一四年十二月三十一日買賣活躍的證券。從第二級轉移至第三級的 CAAP 為於二零一五年十二月三十一日暫停買賣的相關證券。

MSCI 亞洲(日本除外)ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
<b>從第一級轉移至第三級：</b>			
<b>資產</b>			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
金融	(125,950)	-	125,950
	(125,950)	-	125,950

從第一級轉移至第三級的股本證券為於二零一五年十二月三十一日暫停買賣但於二零一四年十二月三十一日買賣活躍的證券。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

MSCI 亞洲新興市場 ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
<b>從第一級轉移至第三級：</b>			
<b>資產</b>			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— 股本證券			
金融	(183,200)	-	183,200
資訊科技	(1)	-	1
	(183,201)	-	183,201

從第一級轉移至第三級的股本證券為於二零一五年十二月三十一日暫停買賣以上但於二零一四年十二月三十一日買賣活躍的證券。

滬深300 A股 ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
<b>從第二級轉移至第三級：</b>			
<b>資產</b>			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
— CAAP			
可選消費	-	(1,007,685)	1,007,685
主要消費	-	(923,093)	923,093
金融	-	(7,653,988)	7,653,988
工業	-	(1,697,883)	1,697,883
資訊科技	-	(3,432,773)	3,432,773
電訊服務	-	(806,455)	806,455
公用事業	-	(278,679)	278,679
	-	(15,800,556)	15,800,556

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

滬深300 A股ETF	第一級 港元	第二級 港元	第三級 港元
從第三級轉移至第二級：			
資產			
按公平價值透過損益記賬的金融資產			
—CAAP			
保健	-	402,406	(402,406)
工業	-	614,271	(614,271)
資訊科技	-	459,889	(459,889)
原材料	-	379,082	(379,082)
公用事業	-	423,953	(423,953)
	-	2,279,601	(2,279,601)

從第二級轉移至第三級的CAAP為於二零一五年十二月三十一日暫停買賣的相關證券。從第三級轉移至第二級的CAAP為於二零一四年十二月三十一日暫停買賣但於截至二零一五年十二月三十一日止年度恢復買賣的相關證券。

下表載列截至十二月三十一日止年度MSCI中國ETF所持第三級股本證券的變動。

	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>股本證券</b>		
<b>年初結餘</b>	10,223,315	149,904
由第一級轉移至第三級	-	10,223,315
由第三級轉移至第一級	(3,319,546)	-
出售	(4,931,752)	(407,366)
於全面收入報表確認的(虧損)/收益	(1,971,983)	257,462
<b>年終結餘</b>	34	10,223,315
於報告年度末所持資產計入全面收入報表的年內虧損總額	-	(21,519,917)

下表載列截至十二月三十一日止期間MSCI中國A股ETF所持第三級股本證券的變動。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	二零一六年 人民幣
<b>股本證券</b>	
由第一級轉移至第三級	1,265,617
<b>年終結餘</b>	1,265,617
於報告期末所持資產計入全面收入報表的期內收益總額	8,515

下表載列截至十二月三十一日止年度A50中國ETF所持第三級衍生工具的變動。

	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>CAAP及股本證券</b>		
<b>年初結餘</b>	2,284,392,062	-
由第一級轉移至第三級	-	781,952,955
由第二級轉移至第三級	-	1,502,439,107
出售	(1,633,885,691)	-
於全面收入報表確認的虧損	(650,506,371)	-
<b>年終結餘</b>	-	2,284,392,062
於報告年度末所持資產計入全面收入報表的年內虧損總額	-	(859,677,271)

下表載列截至十二月三十一日止年度MSCI亞洲(日本除外)ETF所持第三級股本證券的變動。

	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>股本證券</b>		
<b>年初結餘</b>	125,950	-
由第一級轉移至第三級	1	125,950
出售	(125,959)	-
於全面收入報表確認的收益	9	-
<b>年終結餘</b>	1	125,950
於報告年度末所持資產計入全面收入報表的年內收益總額	-	20,007

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

下表載列截至十二月三十一日止年度 MSCI 亞洲新興市場 ETF 所持第三級股本證券的變動。

	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>股本證券</b>		
年初結餘	183,201	-
由第一級轉移至第三級	-	183,201
由第三級轉移至第一級	(132,750)	-
出售	(12,264)	-
於全面收入報表確認的虧損	(38,186)	-
<b>年終結餘</b>	<b>1</b>	<b>183,201</b>
於報告年度末所持資產計入全面收入報表的年內虧損總額	-	(166,351)

下表載列截至十二月三十一日止年度滬深 300 A 股 ETF 所持第三級衍生工具的變動。

	二零一六年 港元	二零一五年 港元
<b>CAAP</b>		
年初結餘	16,829,322	6,292,450
由第二級轉移至第三級	213,686	15,800,556
由第三級轉移至第二級	(6,330,965)	(2,279,601)
購買	-	1,053,653
出售	(6,781,066)	(4,601,845)
於全面收入報表確認的(虧損)/收益	(3,717,291)	564,109
<b>年終結餘</b>	<b>213,686</b>	<b>16,829,322</b>
於報告年度末所持資產計入全面收入報表的年內(虧損)/收益總額	(103,218)	1,426,979

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

下表載列截至十二月三十一日止期間韓國綜合股價 200 ETF 所持第三級股本證券的變動。

	二零一六年 美元
<b>股本證券</b>	
由第一級轉移至第三級	9,681
<b>期終結餘</b>	9,681
於報告期間末所持資產計入全面收入報表的期內虧損總額	(909)

下表載列截至十二月三十一日止期間富時 100 ETF 所持第三級股本證券的變動。

	二零一六年 英鎊
<b>股本證券</b>	
由第一級轉移至第三級	313
<b>期終結餘</b>	313
於報告期間末所持資產計入全面收入報表的期內收益總額	313

計入財務狀況報表的資產及負債(按公平價值透過損益記賬的金融資產及金融負債除外)乃按攤銷成本列賬。其賬面值為公平價值的適當約數。

### (e) 資本風險管理

成分基金的資本乃以未贖回的可贖回單位代表。成分基金的目標為提供與相關指數表現大致接近的投資回報。管理人可：

- 根據成分基金的組成文件贖回及發行新基金單位；
- 於釐定成分基金向基金單位持有人的分派金額時行使酌情權；及
- 在成分基金的章程中規定的若干情況下暫停增設及贖回基金單位。

### (f) 於其他實體的權益

成分基金於其他基金的投資受限於其他各基金章程內的條款及條件，並易承受因該等其他基金未來價值的不確定性而導致的市價風險。管理人經對其他基金及其策略作出廣泛盡職審查後，方始作出投資決定。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，除 SENSEX 印度 ETF、MSCI 亞洲(日本除外)ETF 及 MSCI 亞洲新興市場 ETF 外，概無成分基金在其他基金中持有投資。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### SENSEX 印度 ETF

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，SENSEX 印度 ETF 投資於毛里求斯附屬公司。SENSEX 印度 ETF 可每日要求贖回其於毛里求斯附屬公司的投資。

SENSEX 印度 ETF 按公平價值記賬的於毛里求斯附屬公司的投資載於下表。該等投資於財務狀況報表內計入按公平價值透過損益記賬的金融資產。

截至二零一六年十二月三十一日

策略	毛里求斯附屬公司的 資產淨值 百萬港元	投資公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
股票指數追蹤	798	797,797,824	99.77

截至二零一五年十二月三十一日

策略	毛里求斯附屬公司的 資產淨值 百萬港元	投資公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
股票指數追蹤	826	826,151,554	99.76

SENSEX 印度 ETF 於毛里求斯附屬公司的權益的最高虧損風險相等於其於毛里求斯附屬公司投資的公平價值總額。

一旦 SENSEX 印度 ETF 出售其於毛里求斯附屬公司的股份，SENSEX 印度 ETF 即不再承受來自毛里求斯附屬公司的任何風險。

SENSEX 印度 ETF 的投資策略要求定期買賣毛里求斯附屬公司。截至二零一六年十二月三十一日止年度內於毛里求斯附屬公司的總購買額為 14,217,607 港元(二零一五年：52,298,984 港元)。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，概不存在資本承擔責任，亦無應付毛里求斯附屬公司的未結清購置款項。

截至二零一六年十二月三十一日止年度，於毛里求斯附屬公司的投資所引致的淨收益總額為 4,624,765 港元(二零一五年：淨虧損 91,566,653 港元)。

### MSCI 亞洲(日本除外)ETF

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，MSCI 亞洲(日本除外)ETF 投資於新加坡 MSCI 印度 ETF，以獲取投資於基礎指數內印度證券的機會。MSCI 亞洲(日本除外)ETF 可每日要求贖回其於新加坡 MSCI 印度 ETF 的投資。

MSCI 亞洲(日本除外)ETF 按公平價值記賬的於新加坡 MSCI 印度 ETF 的投資載於下表。該等投資於財務狀況報表內計入按公平價值透過損益記賬的金融資產。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

截至二零一六年十二月三十一日

策略	新加坡 MSCI 印度 ETF 的資產淨值 百萬港元	投資公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
股票指數追蹤	2,829	409,017,449	9.71%

截至二零一五年十二月三十一日

策略	新加坡 MSCI 印度 ETF 的資產淨值 百萬港元	投資公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
股票指數追蹤	3,967	8,945,812	9.73

MSCI 亞洲(日本除外)ETF 於新加坡 MSCI 印度 ETF 的權益的最高虧損風險相等於其於新加坡 MSCI 印度 ETF 投資的公平價值總額。

一旦 MSCI 亞洲(日本除外)ETF 出售其於新加坡 MSCI 印度 ETF 的股份，MSCI 亞洲(日本除外)ETF 即不再承受來自新加坡 MSCI 印度 ETF 的任何風險。

MSCI 亞洲(日本除外)ETF 的投資策略要求定期買賣新加坡 MSCI 印度 ETF。截至二零一六年十二月三十一日止年度內於新加坡 MSCI 印度 ETF 的總購買額為 423,794,084 港元(二零一五年：17,402,438 港元)。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，概不存在資本承擔責任，亦無應付新加坡 MSCI 印度 ETF 的未結清購置款項。

截至二零一六年十二月三十一日止年度，於新加坡 MSCI 印度 ETF 的投資所引致的淨虧損總額為 19,850,277 港元(二零一五年：淨虧損 1,887,238 港元)。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### MSCI亞洲新興市場ETF

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，MSCI亞洲新興市場ETF投資於SENSEX印度ETF。MSCI亞洲新興市場ETF可每日要求贖回其於SENSEX印度ETF的投資。

MSCI亞洲新興市場ETF按公平價值記賬的於SENSEX印度ETF的投資載於下表。該等投資於財務狀況報表內計入按公平價值透過損益記賬的金融資產。

截至二零一六年十二月三十一日

策略	SENSEX印度ETF的 資產淨值 百萬港元	投資公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
股票指數追蹤	800	14,065,163	11.79

截至二零一五年十二月三十一日

策略	SENSEX印度ETF的 資產淨值 百萬港元	投資公平價值 港元	佔資產淨值 百分比
股票指數追蹤	828	14,522,745	11.85

MSCI亞洲新興市場ETF於SENSEX印度ETF的權益的最高虧損風險相等於其於SENSEX印度ETF投資的公平價值總額。

當MSCI亞洲新興市場ETF出售其於SENSEX印度ETF的股份，MSCI亞洲新興市場ETF將不再承受來自SENSEX印度ETF的任何風險。

MSCI亞洲新興市場ETF的投資策略要求定期買賣SENSEX印度ETF。截至二零一六年十二月三十一日止年度，於SENSEX印度ETF的總購買額為813,480港元(二零一五年：2,500,258港元)。

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日，概不存在資本承擔責任，亦無應付SENSEX印度ETF的未結清購置款項。

截至二零一六年十二月三十一日止年度，於SENSEX印度ETF的投資所引致的淨虧損總額為39,824港元(二零一五年：淨虧損2,027,144港元)。

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

### 12 分派

	iShares 安碩 MSCI 中國指數 ETF		iShares 安碩 MSCI 中國 A 股國際指數 ETF
	二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 人民幣
末期分派			
— 於二零一五年十二月二十八日就 125,400,000 個單位派發 0.690 港元	-	(86,526,000)	-
— 於二零一六年十二月二十八日就 77,400,000 個單位派發 0.460 港元	(35,604,000)	-	-
— 於二零一六年十二月二十八日就 10,500,000 個單位派發人民幣 0.120 元	-	-	(1,260,000)

	iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)		iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)	
	二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
末期分派				
— 於二零一五年十二月二十八日就 3,398,000,000 個單位派發 0.300 港元	-	(1,019,400,000)	-	-
— 於二零一六年十二月二十八日就 2,654,000,000 個單位派發 0.300 港元	(796,200,000)	-	-	-
— 於二零一五年十二月二十八日就 2,400,000 個單位派發 0.750 港元	-	-	-	(1,800,000)
— 於二零一六年十二月二十八日就 105,200,000 個單位派發 0.270 港元	-	-	(28,404,000)	-

# iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

	iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF		iShares 安碩滬深 300 A 股指數 ETF* (*此基金為一隻合成交易所買賣基金)	
	二零一六年 港元	二零一五年 港元	二零一六年 港元	二零一五年 港元
末期分派				
— 於二零一五年十二月二十八日就 3,200,000 個單位派發 0.960 港元	-	(3,072,000)	-	-
— 於二零一六年十二月二十八日就 3,000,000 個單位派發 0.700 港元	(2,100,000)	-	-	-
— 於二零一五年十二月二十八日就 10,000,000 個單位派發 0.440 港元	-	-	-	(4,400,000)
— 於二零一六年十二月二十八日就 8,000,000 個單位派發 0.440 港元	-	-	(3,520,000)	-

	iShares 安碩 核心 MSCI 台灣指數 ETF
	二零一六年 美元
末期分派	
— 於二零一六年十二月二十八日就 17,600,000 個單位派發 0.020 美元	(352,000)

截至二零一六年及二零一五年十二月三十一日止年度，SENSEX 印度 ETF 並無作出任何分派。

截至二零一六年十二月三十一日止期間，韓國綜合股價 200 ETF、DAX ETF、歐元區 STOXX 50 ETF、富時 100 ETF 及納斯達克 100 ETF 並無作出任何分派。

### 13 分類資料

管理人代表成分基金作出策略性資源配置，並根據作出策略決策所用的經審閱報告釐定經營分類。

管理人認為，各成分基金擁有單一經營分類，即投資證券。成分基金的目標為追蹤各自指數的表現及按與所追蹤指數的特徵密切吻合的證券比重及行業比重投資絕大部分指數成分股。

管理人所用有關成分基金的資產、負債及表現的內部財務資料與財務狀況報表及全面收入報表所披露者一致。

# iShares安碩亞洲信託基金的成分基金

## 財務報表附註(續)

成分基金位於香港。成分基金的全部收入來自對組成相關追蹤指數的證券的投資。成分基金的投資按相關地區劃分，但由於管理人認為編製地區資料的成本過高，且管理人一般不會使用該資料管理成分基金，故並無就基金表現呈報地區資料。

成分基金並無資產分類為非流動資產。成分基金擁有與相關追蹤指數的證券比重及行業比重非常接近的投資組合。有關佔各成分基金資產淨值逾10%的投資持股請參閱附註10。

### 14 結算日後事項

截至二零一七年二月二十八日，滬深300 A股ETF已完成從「合成模擬」策略至「實質模擬」策略的過渡，iShares安碩滬深300 A股指數ETF\*（\*此基金為一隻合成交易所買賣基金）已更名為iShares安碩核心滬深300指數ETF。

### 15 財務報表核准

本財務報表已於二零一七年四月二十五日經信託人及管理人核准。

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.67%)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.67%)</b>			
<b>中國(99.67%)</b>			
三生製藥	177,300	1,338,615	0.10
58同城-ADR	13,853	3,007,323	0.21
瑞聲科技控股有限公司	127,265	8,965,819	0.64
中國農業銀行-H股	4,166,371	13,249,060	0.94
中國國際航空股份有限公司-H股	324,829	1,607,904	0.11
阿里巴巴集團控股有限公司-SP ADR	194,065	132,120,248	9.38
阿里巴巴健康信息技術有限公司	588,633	2,295,669	0.16
阿里巴巴影業集團有限公司	2,046,176	2,578,182	0.18
中國鋁業股份有限公司-H股	703,035	2,249,712	0.16
安徽海螺水泥股份有限公司-H股	204,248	4,309,633	0.31
安踏體育用品有限公司	178,049	4,121,834	0.29
中國航空科技工業-H股	377,599	2,016,379	0.14
百度股份有限公司-Spon ADR	47,032	59,951,474	4.26
中國銀行股份有限公司-H股	13,764,936	47,351,380	3.36
交通銀行股份有限公司-H股	1,462,532	8,204,804	0.58
北京首都國際機場-H股	268,535	2,105,314	0.15
北京控股有限公司	79,212	2,903,120	0.21
北控水務集團有限公司	693,266	3,577,253	0.25
百麗國際控股有限公司	1,057,109	4,608,995	0.33
華晨中國汽車控股有限公司	538,568	5,751,906	0.41
比亞迪股份有限公司-H股	114,148	4,662,946	0.33
中國廣核電力股份有限公司-H股	1,903,105	4,053,614	0.29
中國信達資產管理股份有限公司-H股	1,558,491	4,379,360	0.31
中信銀行股份有限公司-H股	1,524,042	7,513,527	0.53
中國中煤能源股份有限公司-H股	365,365	1,344,543	0.10
中國交通建設股份有限公司-H股	789,009	7,037,960	0.50
中國通信服務股份有限公司-H股	425,412	2,101,535	0.15
中國海螺創業控股有限公司	241,255	3,329,319	0.24
中國建設銀行-H股	14,574,850	87,011,854	6.18
中國光大銀行股份有限公司-H股	525,690	1,855,686	0.13
中國光大國際有限公司	439,544	3,863,592	0.27
中國光大控股有限公司	171,432	2,530,336	0.18
中國恒大集團(前稱恒大地產集團)	730,665	3,529,112	0.25
中國銀河證券股份有限公司-H股	525,908	3,676,097	0.26
中國燃氣控股有限公司	307,509	3,234,995	0.23
中國華融資產管理-H股	787,596	2,197,393	0.16
中國輝山乳業控股有限公司	720,125	2,167,576	0.15
中國金茂控股集團有限公司	544,359	1,137,710	0.08
中國人壽保險股份有限公司-H股	1,295,117	26,161,363	1.86

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.67%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.67%)(續)</b>			
<b>中國(99.67%)(續)</b>			
龍源電力集團股份有限公司—H股	565,859	3,429,106	0.24
康哲藥業控股有限公司	226,542	2,781,936	0.20
中國蒙牛乳業有限公司	448,916	6,706,805	0.48
招商銀行—H股	680,181	12,365,691	0.88
招商局港口控股有限公司(前稱招商局國際有限公司)	211,986	4,078,611	0.29
中國民生銀行—H股	986,797	8,180,547	0.58
中國移動有限公司	1,062,857	87,366,845	6.20
中國建材股份有限公司—H股	512,344	1,931,537	0.14
中海油田服務股份有限公司—H股	323,061	2,326,039	0.17
中國海外發展有限公司	666,002	13,686,341	0.97
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—H股	447,777	12,112,368	0.86
中國石油化工股份有限公司—H股	4,401,330	24,207,315	1.72
中國電力國際發展有限公司	589,634	1,656,872	0.12
中國鐵建股份有限公司—H股	351,553	3,508,499	0.25
中國中鐵股份有限公司—H股	712,117	4,543,306	0.32
華潤啤酒(控股)有限公司	266,229	4,099,927	0.29
華潤燃氣控股有限公司	159,116	3,468,729	0.25
華潤置地有限公司	471,120	8,216,333	0.58
華潤電力控股有限公司	343,257	4,228,926	0.30
中國神華能源股份有限公司—H股	573,037	8,366,340	0.59
中國南方航空股份有限公司—H股	323,434	1,303,439	0.09
中國建築國際集團有限公司	287,540	3,335,464	0.24
中國太平保險控股有限公司	262,446	4,199,136	0.30
中國電信股份有限公司—H股	2,433,949	8,713,537	0.62
中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司	1,051,498	9,495,027	0.67
萬科企業股份有限公司—H股	234,335	4,147,729	0.29
重慶長安汽車股份有限公司—B股	147,988	1,641,187	0.12
重慶農村商業銀行—H股	469,177	2,134,755	0.15
中國中信股份有限公司	766,548	8,508,683	0.60
中信證券股份有限公司—H股	360,249	5,677,524	0.40
中國海洋石油有限公司	3,075,884	29,836,075	2.12
中遠海運港口有限公司(前稱中遠太平洋有限公司)	290,161	2,260,354	0.16
碧桂園控股有限公司	923,040	4,005,994	0.28
中國中車股份有限公司—H股	722,814	5,030,785	0.36
石藥集團有限公司	737,585	6,107,204	0.43
攜程旅行網—ADR	64,237	19,921,564	1.41
東風汽車集團股份有限公司—H股	452,056	3,422,064	0.24
新奧能源控股有限公司	135,243	4,314,252	0.31

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.67%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.67%)(續)</b>			
<b>中國(99.67%)(續)</b>			
遠東宏信有限公司	359,842	2,392,949	0.17
復星國際有限公司	456,289	5,010,053	0.36
豐盛控股有限公司	1,206,008	4,365,749	0.31
福耀玻璃工業集團股份有限公司—H股	83,486	2,007,838	0.14
保利協鑫能源控股有限公司	2,318,304	2,156,023	0.15
吉利汽車控股有限公司	888,161	6,581,273	0.47
廣發證券股份有限公司—H股	242,676	3,926,498	0.28
國美電器控股有限公司	1,994,689	1,875,008	0.13
長城汽車股份有限公司—H股	552,484	3,999,984	0.28
粵海投資有限公司	478,429	4,899,113	0.35
廣州汽車集團股份有限公司—H股	374,412	3,511,985	0.25
廣州富力地產股份有限公司—H股	164,687	1,544,764	0.11
海爾電器集團有限公司	224,002	2,732,824	0.19
海天國際控股有限公司	113,973	1,734,669	0.12
海通證券股份有限公司—H股	522,579	6,950,301	0.49
漢能薄膜發電集團有限公司	3,353,670	34	0.00
恆安國際集團有限公司	127,405	7,255,715	0.52
恒騰網絡集團有限公司	3,741,086	1,459,024	0.10
華能國際電力股份有限公司—H股	753,664	3,873,833	0.28
華能新能源股份有限公司—H股	709,842	1,788,802	0.13
華泰證券股份有限公司—H股	260,424	3,854,275	0.27
中國工商銀行—H股	12,799,913	59,519,595	4.22
京東商城電子商務有限公司—ADR	116,668	23,011,612	1.63
江蘇寧滬高速公路股份有限公司—H股	218,407	2,140,389	0.15
江西銅業股份有限公司—H股	222,413	2,406,509	0.17
金山軟件有限公司	139,026	2,210,513	0.16
昆侖能源有限公司	575,084	3,335,487	0.24
聯想集團有限公司	1,277,005	6,001,923	0.43
龍湖地產	268,439	2,641,440	0.19
網易公司—ADR	13,627	22,751,139	1.62
新華人壽保險股份有限公司—H股	126,991	4,520,880	0.32
新東方教育科技集團—SP ADR	22,572	7,367,673	0.52
玖龍紙業(控股)有限公司	290,983	2,045,610	0.15
中國人民保險集團股份有限公司—H股	1,244,109	3,806,974	0.27
中國石油天然氣股份有限公司—H股	3,638,568	21,030,923	1.49
中國人民財產保險股份有限公司—H股	811,447	9,802,280	0.70
中國平安保險(集團)股份有限公司—H股	905,897	35,148,804	2.50
Qunar Cayman Islands Ltd—ADR	6,386	1,491,785	0.11
中芯國際集成電路製造有限公司	478,729	5,830,919	0.41
山東威高集團醫用高分子製品股份有限公司—H股	309,568	1,603,562	0.11

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.67%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.67%)(續)</b>			
<b>中國(99.67%)(續)</b>			
上海電氣集團總公司—H股	502,810	1,744,751	0.12
上海復星醫藥(集團)股份有限公司—H股	74,192	1,762,060	0.13
上海實業控股有限公司	90,032	1,890,672	0.13
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司—B股	167,360	1,899,638	0.14
上海醫藥集團股份有限公司—H股	122,862	2,184,486	0.16
申洲國際集團	99,982	4,904,117	0.35
世茂房地產控股有限公司	223,675	2,268,064	0.16
新浪公司	9,844	4,639,615	0.33
中國生物製藥有限公司	792,761	4,328,475	0.31
遠洋集團控股有限公司(前稱遠洋地產控股有限公司)	563,238	1,954,436	0.14
中石化煉化工程(集團)股份有限公司—H股	221,271	1,431,623	0.10
中國石化上海石油化工股份有限公司—H股	622,386	2,614,021	0.19
國藥控股股份有限公司—H股	208,491	6,661,287	0.47
中國外運股份有限公司—H股	381,709	1,320,713	0.09
Soho中國有限公司	388,839	1,485,365	0.11
高鑫零售有限公司	424,960	2,889,728	0.21
融創中國控股有限公司	349,405	2,253,662	0.16
舜宇光學科技(集團)有限公司	123,062	4,177,955	0.30
好未來教育集團—ADR	7,615	4,141,673	0.29
騰訊控股有限公司	982,679	186,414,206	13.23
康師傅控股有限公司	349,906	3,299,614	0.23
中國民航信息網絡股份有限公司—H股	166,325	2,711,097	0.19
青島啤酒股份有限公司—H股	64,627	1,893,571	0.13
唯品會控股有限公司—ADR	68,377	5,836,810	0.41
中國旺旺控股有限公司	932,016	4,632,120	0.33
新浪微博—Spon ADR	5,514	1,735,685	0.12
濰柴動力股份有限公司—H股	173,403	2,070,432	0.15
兗州煤業股份有限公司—H股	331,249	1,752,307	0.12
百勝中國控股有限公司	69,304	14,034,911	1.00
歡聚時代—ADR	4,304	1,315,428	0.09
浙江滬杭甬高速公路股份有限公司—H股	254,808	1,885,579	0.13
株洲中車時代電氣股份有限公司—H股(前稱株洲南車 時代電氣股份有限公司—H股)	97,503	3,836,743	0.27
紫金礦業集團股份有限公司—H股	1,028,292	2,570,730	0.18
中興通訊股份有限公司—H股	122,080	1,645,638	0.12
總上市股本		1,404,195,931	99.67

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.67%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>期貨(0.00%)</b>			
<b>中國(0.00%)</b>			
一月十七日的H股指數期貨	7	72,150	0.00
期貨總額		72,150	0.00
投資總額		1,404,268,081	99.67
其他資產淨值		4,607,009	0.33
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		1,408,875,090	100.00
投資總額(按成本)		1,559,460,067	

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
三生製藥	-	264,044	-	86,744	177,300
58同城-ADR	12,506	11,177	-	9,830	13,853
瑞豐科技控股有限公司	249,931	29,014	-	151,680	127,265
中國農業銀行-H股	7,827,014	921,444	-	4,582,087	4,166,371
中國國際航空股份有限公司-H股	619,995	64,922	-	360,088	324,829
阿里巴巴集團控股有限公司-SP ADR	170,601	165,298	-	141,834	194,065
阿里巴巴健康信息技術有限公司	832,535	215,980	-	459,882	588,633
阿里巴巴影業集團有限公司	3,431,710	386,678	-	1,772,212	2,046,176
中國鋁業股份有限公司-H股	1,338,579	140,344	-	775,888	703,035
安徽海螺水泥股份有限公司-H股	418,970	54,010	-	268,732	204,248
安踏體育用品有限公司	339,613	35,568	-	197,132	178,049
中國航空科技工業-H股	719,931	75,422	-	417,754	377,599
百度股份有限公司-Spon ADR	46,949	38,628	-	38,545	47,032
中國銀行股份有限公司-H股	26,971,744	3,062,746	-	16,269,554	13,764,936
交通銀行股份有限公司-H股	2,971,292	350,704	-	1,859,464	1,462,532
北京首都國際機場-H股	509,567	53,516	-	294,548	268,535
北京控股有限公司	174,500	18,284	-	113,572	79,212
北控水務集團有限公司	1,479,108	154,980	-	940,822	693,266
百麗國際控股有限公司	1,574,485	489,872	-	1,007,248	1,057,109
華晨中國汽車控股有限公司	1,023,938	107,444	-	592,814	538,568
比亞迪股份有限公司-H股	217,660	22,806	-	126,318	114,148
神州租車有限公司	282,411	13,260	-	295,671	-
中國廣核電力股份有限公司-H股	3,032,609	438,170	-	1,567,674	1,903,105
中國信達資產管理股份有限公司-H股	2,969,179	311,208	-	1,721,896	1,558,491
中信銀行股份有限公司-H股	2,779,418	305,980	-	1,561,356	1,524,042
中國中煤能源股份有限公司-H股	906,667	82,848	-	624,150	365,365
中國交通建設股份有限公司-H股	1,503,297	157,562	-	871,850	789,009
中國通信服務股份有限公司-H股	841,086	86,390	-	502,064	425,412
中國海螺創業控股有限公司	459,342	48,164	-	266,251	241,255
中國建設銀行-H股	28,568,450	3,254,318	-	17,247,918	14,574,850
中國光大銀行股份有限公司-H股	1,166,406	112,706	-	753,422	525,690
中國光大國際有限公司	837,436	87,774	-	485,666	439,544
中國光大控股有限公司	315,450	45,710	-	189,728	171,432
中國恒大集團(前稱恒大地產集團)	1,478,383	149,952	-	897,670	730,665
中國銀河證券股份有限公司-H股	1,128,064	110,934	-	713,090	525,908
中國燃氣控股有限公司	590,960	61,640	-	345,091	307,509
中國華融資產管理-H股	-	800,000	-	12,404	787,596
中國輝山乳業控股有限公司	2,132,949	161,785	-	1,574,609	720,125
中國國際海運-H股	175,944	8,260	-	184,204	-
中國金茂控股集團有限公司	1,273,010	143,428	-	872,079	544,359

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
中國人壽保險股份有限公司—H股	2,526,835	280,498	-	1,512,216	1,295,117
龍源電力集團股份有限公司—H股	1,077,707	112,984	-	624,832	565,859
康哲藥業控股有限公司	379,902	42,816	-	196,176	226,542
中國蒙牛乳業有限公司	932,164	97,702	-	580,950	448,916
招商銀行—H股	1,558,616	161,530	-	1,039,965	680,181
招商局港口控股有限公司(前稱招商局國際有限公司)	395,242	44,530	-	227,786	211,986
中國民生銀行—H股	2,000,789	236,636	-	1,250,628	986,797
中國移動有限公司	2,085,407	245,321	-	1,267,871	1,062,857
中國建材股份有限公司—H股	977,822	102,386	-	567,864	512,344
中海油田服務股份有限公司—H股	614,737	64,476	-	356,152	323,061
中國海外發展有限公司	1,339,848	149,314	-	823,160	666,002
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—H股	895,225	101,912	-	549,360	447,777
中國石油化工股份有限公司—H股	8,662,940	961,818	-	5,223,428	4,401,330
中國電力國際發展有限公司	1,119,824	117,572	-	647,762	589,634
中國鐵建股份有限公司—H股	669,903	70,202	-	388,552	351,553
中國中鐵股份有限公司—H股	1,357,209	142,218	-	787,310	712,117
華潤啤酒(控股)有限公司	413,613	153,624	-	301,008	266,229
華潤燃氣控股有限公司	301,034	31,672	-	173,590	159,116
華潤置地有限公司	941,348	98,734	-	568,962	471,120
華潤電力控股有限公司	650,893	68,402	-	376,038	343,257
中國神華能源股份有限公司—H股	1,153,799	137,214	-	717,976	573,037
中國南方航空股份有限公司—H股	617,654	64,658	-	358,878	323,434
中國建築國際集團有限公司	613,272	64,616	-	390,348	287,540
中國太平保險控股有限公司	549,196	57,560	-	344,310	262,446
中國電信股份有限公司—H股	4,710,697	549,886	-	2,826,634	2,433,949
中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司	2,032,572	237,690	-	1,218,764	1,051,498
萬科企業股份有限公司—H股	446,431	46,790	-	258,886	234,335
重慶長安汽車股份有限公司—B股	300,988	24,600	-	177,600	147,988
重慶農村商業銀行—H股	853,495	135,786	-	520,104	469,177
中國中信股份有限公司	1,481,606	173,214	-	888,272	766,548
中信證券股份有限公司—H股	734,827	77,032	-	451,610	360,249
中國海洋石油有限公司	6,062,898	673,666	-	3,660,680	3,075,884
中遠海運發展股份有限公司—H股(前稱中海集裝箱運輸股份有限公司—H股)	1,500,035	144,018	-	1,644,053	-
中遠海運控股股份有限公司—H股(前稱中國遠洋控股股份有限公司—H股)	1,030,785	99,042	-	1,129,827	-
中遠海運港口有限公司(前稱中遠太平洋有限公司)	705,183	62,805	-	477,827	290,161
碧桂園控股有限公司	1,916,990	254,714	-	1,248,664	923,040
中國中車股份有限公司—H股	1,483,750	183,766	-	944,702	722,814

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
石藥集團有限公司	1,403,379	147,202	-	812,996	737,585
攜程旅行網—ADR	48,745	65,085	-	49,593	64,237
大連萬達商業地產股份有限公司—H股	199,363	9,360	-	208,723	-
大唐國際發電股份有限公司—H股	989,617	46,460	-	1,036,077	-
東風汽車集團股份有限公司—H股	921,480	121,176	-	590,600	452,056
新奧能源控股有限公司	256,447	26,950	-	148,154	135,243
房天下控股有限公司—ADR (前稱搜房控股有限公司—ADR)	43,776	42,542	-	86,318	-
遠東宏信有限公司	603,578	68,002	-	311,738	359,842
復星國際有限公司	731,009	103,122	-	377,842	456,289
豐盛控股有限公司	-	1,225,000	-	18,992	1,206,008
福耀玻璃工業集團股份有限公司—H股	-	84,800	-	1,314	83,486
保利協鑫能源控股有限公司	3,680,782	1,093,041	-	2,455,519	2,318,304
吉利汽車控股有限公司	1,791,141	187,970	-	1,090,950	888,161
廣發證券股份有限公司—H股	462,156	48,454	-	267,934	242,676
高銀地產控股有限公司	517,934	12,160	-	530,094	-
國美電器控股有限公司	4,030,731	454,162	-	2,490,204	1,994,689
長城汽車股份有限公司—H股	1,052,450	110,310	-	610,276	552,484
粵海投資有限公司	955,965	118,182	-	595,718	478,429
廣州汽車集團股份有限公司—H股	750,968	76,532	-	453,088	374,412
廣州富力地產股份有限公司—H股	344,575	34,338	-	214,226	164,687
海爾電器集團有限公司	426,879	44,736	-	247,613	224,002
海天國際控股有限公司	224,243	23,088	-	133,358	113,973
海通證券股份有限公司—H股	1,099,834	128,510	-	705,765	522,579
漢能薄膜發電集團有限公司	4,471,670	-	-	1,118,000	3,353,670
恒安國際集團有限公司	249,287	215,652	-	337,534	127,405
恒騰網絡集團有限公司	-	3,800,000	-	58,914	3,741,086
華能國際電力股份有限公司—H股	572,683	64,522	-	637,205	-
華能國際電力股份有限公司—H股	1,437,229	150,550	-	834,115	753,664
華能新能源股份有限公司—H股	1,352,256	141,736	-	784,150	709,842
華泰證券股份有限公司—H股	350,274	175,419	-	265,269	260,424
博華太平洋國際控股有限公司	5,791,749	135,955	-	5,927,704	-
中國工商銀行—H股	25,048,011	2,849,300	-	15,097,398	12,799,913
京東商城電子商務有限公司—ADR	58,201	146,559	-	88,092	116,668
江蘇寧滬高速公路股份有限公司—H股	414,079	43,520	-	239,192	218,407
江西銅業股份有限公司—H股	447,119	45,504	-	270,210	222,413
金山軟件有限公司	287,852	28,840	-	177,666	139,026
昆侖能源有限公司	1,096,643	114,876	-	636,435	575,084
聯想集團有限公司	2,262,349	465,267	-	1,450,611	1,277,005
龍湖地產	494,643	68,816	-	295,020	268,439
綠葉製藥集團有限公司	450,976	50,808	-	501,784	-

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
網易公司—ADR	13,402	11,158	-	10,933	13,627
新華人壽保險股份有限公司—H股	263,303	27,592	-	163,904	126,991
新東方教育科技集團—SP ADR	22,582	18,600	-	18,610	22,572
新世界中國地產有限公司	884,996	24,930	-	909,926	-
玖龍紙業(控股)有限公司	573,528	59,004	-	341,549	290,983
中國人民保險集團股份有限公司—H股	2,222,119	241,464	-	1,219,474	1,244,109
中國石油天然氣股份有限公司—H股	7,162,782	793,398	-	4,317,612	3,638,568
中國人民財產保險股份有限公司—H股	1,325,410	380,504	-	894,467	811,447
中國平安保險(集團)股份有限公司—H股	1,769,789	201,302	-	1,065,194	905,897
奇虎360科技有限公司—ADR	15,855	10,290	-	26,145	-
親親食品集團(開曼)股份有限公司	-	37,250	-	37,250	-
Qunar Cayman Islands Ltd—ADR	9,061	1,996	-	4,671	6,386
中芯國際集成電路製造有限公司	8,993,157	2,219,176	-	10,733,604	478,729
山東威高集團醫用高分子製品股份有限公司—H股	638,108	71,904	-	400,444	309,568
上海電氣集團總公司—H股	959,462	100,476	-	557,128	502,810
上海復星醫藥(集團)股份有限公司—H股	136,886	15,418	-	78,112	74,192
上海實業控股有限公司	165,788	18,686	-	94,442	90,032
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司—B股	178,800	32,700	98,160	142,300	167,360
上海醫藥集團股份有限公司—H股	234,056	24,528	-	135,722	122,862
申洲國際集團	189,718	24,362	-	114,098	99,982
世茂房地產控股有限公司	471,833	65,304	-	313,462	223,675
瑞安房地產有限公司	1,269,090	228,600	-	1,497,690	-
新浪公司	-	10,000	-	156	9,844
中國生物製藥有限公司	1,509,615	158,258	-	875,112	792,761
遠洋集團控股有限公司(前稱遠洋地產控股有限公司)	1,150,348	171,100	-	758,210	563,238
中石化煉化工程(集團)股份有限公司—H股	436,085	44,858	-	259,672	221,271
中國石化上海石油化工股份有限公司—H股	1,187,396	124,364	-	689,374	622,386
國藥控股股份有限公司—H股	404,863	48,276	-	244,648	208,491
中國外運股份有限公司—H股	640,127	72,134	-	330,552	381,709
Soho中國有限公司	731,003	120,688	-	462,852	388,839
高鑫零售有限公司	809,546	84,854	-	469,440	424,960
融創中國控股有限公司	635,109	103,334	-	389,038	349,405
舜宇光學科技(集團)有限公司	-	125,000	-	1,938	123,062
好未來教育集團—ADR	7,377	5,650	-	5,412	7,615
騰訊控股有限公司	1,755,263	216,180	-	988,764	982,679
康師傅控股有限公司	666,578	69,860	-	386,532	349,906
中國民航信息網絡股份有限公司—H股	316,561	33,200	-	183,436	166,325
青島啤酒股份有限公司—H股	122,065	12,856	-	70,294	64,627
唯品會控股有限公司—ADR	67,546	56,370	-	55,539	68,377
中國旺旺控股有限公司	2,006,114	206,796	-	1,280,894	932,016

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
新浪微博—Spon ADR	-	5,600	-	86	5,514
濰柴動力股份有限公司—H股	329,597	34,580	-	190,774	173,403
兗州煤業股份有限公司—H股	653,600	67,196	-	389,547	331,249
Youku Tudou Inc—ADR	20,289	570	-	20,859	-
越秀地產股份有限公司	2,316,204	108,740	-	2,424,944	-
百勝中國控股有限公司	-	74,000	-	4,696	69,304
歡聚時代—ADR	5,134	3,730	-	4,560	4,304
浙江滬杭甬高速公路股份有限公司—H股	486,650	50,934	-	282,776	254,808
株洲中車時代電氣股份有限公司—H股(前稱株 南車時代電氣股份有限公司—H股)	176,565	19,042	-	98,104	97,503
紫金礦業集團股份有限公司—H股	1,959,278	205,338	-	1,136,324	1,028,292
中興通訊股份有限公司—H股	256,524	28,910	-	163,354	122,080
<b>期貨</b>					
二零一六年二月的恒生指數期貨	-	1	-	1	-
二零一六年十二月的恒生中國企業指數期貨	-	7	-	7	-
二零一六年一月的H股指數期貨	4	-	-	4	-
二零一六年三月的H股指數期貨	-	7	-	7	-
二零一六年四月的H股指數期貨	-	26	-	26	-
二零一六年五月的H股指數期貨	-	26	-	26	-
二零一六年六月的H股指數期貨	-	98	-	98	-
二零一六年七月的H股指數期貨	-	155	-	155	-
二零一六年八月的H股指數期貨	-	150	-	150	-
二零一六年九月的H股指數期貨	-	103	-	103	-
二零一六年十月的H股指數期貨	-	24	-	24	-
二零一六年十一月的H股指數期貨	-	24	-	24	-
二零一七年一月的H股指數期貨	-	7	-	-	7
<b>上市供股權</b>					
華潤啤酒(控股)有限公司—供股權	-	-	101,822	101,822	-
保利協鑫能源控股有限公司—供股權	736,156	-	-	736,156	-

# iShares安碩MSCI中國指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 港元	成分基金交易 資產淨值 港元
截至下列日期財務期間結束時		
二零一四年十二月三十一日	21.33	1,267,054,099
二零一五年十二月三十一日	18.88	2,412,353,952
二零一六年十二月三十一日	18.49	1,408,897,972

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 港元	最低每單位 資產淨值 港元
截至下列日期止財務期間		
二零零七年十二月三十一日	35.30*	15.20*
二零零八年十二月三十一日	28.38	9.25
二零零九年十二月三十一日	22.61	11.58
二零一零年十二月三十一日	24.50	18.57
二零一一年十二月三十一日	23.35	15.00
二零一二年十二月三十一日	20.66	16.92
二零一三年十二月三十一日	21.89	17.00
二零一四年十二月三十一日	22.56	18.10
二零一五年十二月三十一日	27.37	18.21
二零一六年十二月三十一日	21.02	15.28

\* 為年內單位分拆的影響所作的調整。

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)</b>			
<b>中國(99.59%)</b>			
航天工業發展股份有限公司—A股	9,100	139,776	0.21
中國農業銀行—A股	251,700	780,270	1.18
中國國際航空股份有限公司—A股	13,500	97,200	0.15
航天信息股份有限公司—A股	6,500	129,675	0.20
奧飛娛樂股份有限公司—A股	4,600	104,420	0.16
中國鋁業股份有限公司—A股	36,000	151,920	0.23
鞍鋼股份有限公司—A股	14,176	71,447	0.11
安徽海螺水泥股份有限公司—A股	13,500	228,960	0.35
安徽江淮汽車股份有限公司—A股	5,600	64,736	0.10
安徽新華傳媒股份有限公司—A股	4,300	75,551	0.11
安徽中鼎密封件股份有限公司—A股	4,200	108,948	0.17
安信信託股份有限公司—A股	6,300	148,806	0.23
北極光光電有限公司—A股	1,700	45,815	0.07
中航動力控制股份有限公司—A股	4,102	101,483	0.15
中航飛機股份有限公司—A股	8,500	180,710	0.27
中航動力股份有限公司—A股	6,000	196,440	0.30
中航航空科技股份有限公司—A股	4,500	55,080	0.08
中航投資控股股份有限公司—A股	28,000	171,360	0.26
中航工業機電系統股份有限公司—A股	5,250	96,022	0.15
中航直升機有限責任公司—A股	2,100	101,682	0.15
中航光電科技股份有限公司—A股	2,100	76,209	0.12
北京銀行股份有限公司—A股	50,780	495,613	0.75
中國銀行股份有限公司—A股	157,800	542,832	0.82
交通銀行股份有限公司—A股	125,900	726,443	1.10
貴陽銀行股份有限公司—A股	4,200	66,276	0.10
江蘇銀行股份有限公司—A股	8,300	79,929	0.12
南京銀行股份有限公司—A股	18,920	205,093	0.31
寧波銀行股份有限公司—A股	13,500	224,640	0.34
寶山鋼鐵股份有限公司—A股	38,443	244,113	0.37
北京金隅股份有限公司—A股	23,200	103,472	0.16
北京首創股份有限公司—A股	16,800	69,048	0.10
北京首都開發股份有限公司—A股	8,991	106,184	0.16
北京大北農科技集團股份有限公司—A股	14,700	104,370	0.16
北京歌華有線電視網絡股份有限公司—A股	3,800	58,216	0.09
北新集團建材股份有限公司—A股	5,100	52,479	0.08
北京東方園林股份有限公司—A股	8,950	126,641	0.19
北京中長石基信息技術股份有限公司—A股	2,980	72,623	0.11
北京首鋼股份有限公司—A股	15,400	101,948	0.15
北京雙鷺藥業股份有限公司—A股	1,900	50,749	0.08
北京國電清新環保技術股份有限公司—A股	4,000	69,880	0.11
北京天壇生物製品股份有限公司—A股	1,100	43,340	0.07

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
北京同仁堂股份有限公司—A股	4,100	128,658	0.19
北京城建投資發展股份有限公司—A股	5,400	71,982	0.11
北京信威通信技術股份有限公司—A股	10,200	148,920	0.23
北京燕京啤酒股份有限公司—A股	10,500	72,975	0.11
北汽福田汽車股份有限公司—A股	23,800	73,542	0.11
京東方科技集團股份有限公司—A股	113,100	323,466	0.49
渤海金控投資股份有限公司—A股	35,200	251,680	0.38
光明乳業股份有限公司—A股	4,200	54,852	0.08
比亞迪股份有限公司—A股	6,000	298,080	0.45
安徽華信國際控股股份有限公司—A股	7,900	80,343	0.12
長江證券股份有限公司—A股	17,500	179,025	0.27
長園集團股份有限公司—A股	3,360	46,872	0.07
成都三泰控股集團股份有限公司—A股	5,450	47,688	0.07
成都市興蓉環境股份有限公司—A股	10,500	60,480	0.09
航天時代電子技術股份有限公司—A股	3,500	53,340	0.08
中航航空電子系統股份有限公司—A股	4,100	76,096	0.12
中國寶安集團股份有限公司—A股	7,440	77,078	0.12
中工國際工程股份有限公司—A股	3,240	74,261	0.11
中信銀行股份有限公司—A股	19,800	126,918	0.19
中國交通建設股份有限公司—A股	9,300	141,267	0.21
中國建設銀行股份有限公司—A股	30,300	164,832	0.25
中國船舶工業股份有限公司—A股	4,900	135,289	0.20
中國東方航空股份有限公司—A股	26,100	184,527	0.28
中國光大銀行股份有限公司—A股	129,100	504,781	0.76
中國電影股份有限公司—A股	6,200	143,158	0.22
中國第一重型機械集團公司—A股	22,900	123,889	0.19
華夏幸福基業投資開發股份有限公司—A股	7,988	190,913	0.29
中國葛洲壩集團股份有限公司—A股	14,200	130,498	0.20
廣匯汽車服務股份公司—A股	15,100	129,256	0.20
海南天然橡膠產業集團股份有限公司—A股	14,000	97,440	0.15
神州高鐵技術股份有限公司—A股	8,000	74,560	0.11
中國國旅股份有限公司—A股	3,500	151,900	0.23
中國國際海運集裝箱(集團)股份有限公司—A股	4,200	61,404	0.09
中國巨石股份有限公司—A股	8,100	79,704	0.12
中國人壽保險股份有限公司—A股	9,625	231,866	0.35
招商銀行—A股	67,483	1,187,701	1.80
招商局能源運輸股份有限公司—A股	16,000	79,040	0.12
招商證券股份有限公司—A股	19,129	312,377	0.47
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	21,300	349,107	0.53
中國民生銀行—A股	95,400	866,232	1.31
洛陽藥川鋁業集團股份有限公司—A股	30,300	112,716	0.17

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
國藥集團一致藥業股份有限公司—A股	900	60,210	0.09
中國化學工程股份有限公司—A股	14,400	97,488	0.15
中國核能電力股份有限公司—A股	41,900	295,814	0.45
中國有色金屬建設股份有限公司—A股	5,300	42,347	0.06
中國北方稀土(集團)高科技股份有限公司—A股	12,400	152,148	0.23
中國核工業建設集團公司—A股	3,800	65,322	0.10
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	20,300	563,731	0.85
中國石油化工股份有限公司—A股	82,900	448,489	0.68
中國鐵建股份有限公司—A股	34,200	409,032	0.62
中鐵二局股份有限公司—A股	5,600	77,056	0.12
中國中鐵股份有限公司—A股	49,422	437,879	0.66
華潤三九醫藥股份有限公司—A股	3,500	86,555	0.13
中安消股份有限公司—A股	4,700	81,921	0.12
中國神華能源股份有限公司—A股	14,100	228,138	0.35
中國船舶重工股份有限公司—A股	59,600	422,564	0.64
中國船舶重工集團動力股份有限公司—A股	4,000	122,160	0.18
中南出版傳媒集團股份有限公司—A股	6,222	103,659	0.16
中國南方航空股份有限公司—A股	21,900	153,738	0.23
中國東方紅衛星股份有限公司—A股	4,200	131,208	0.20
中國建築—A股	98,200	870,052	1.32
中國聯合網絡—A股	68,900	503,659	0.76
萬科企業股份有限公司—A股	31,500	647,325	0.98
中國西電電氣股份有限公司—A股	18,900	105,462	0.16
中國長江電力股份有限公司—A股	47,400	600,084	0.91
中文天地出版傳媒股份有限公司—A股	4,900	98,980	0.15
重慶長安汽車股份有限公司—A股	11,613	173,498	0.26
重慶市迪馬實業股份有限公司—A股	8,100	60,102	0.09
中信國安信息產業股份有限公司—A股	14,000	128,520	0.19
中信重工機械股份有限公司—A股	12,600	70,686	0.11
中信證券股份有限公司—A股	33,000	529,980	0.80
中儲發展股份有限公司—A股	5,900	53,513	0.08
中糧地產(集團)股份有限公司—A股	4,700	41,924	0.06
中糧屯河股份有限公司—A股	6,700	83,482	0.13
中遠海運發展股份有限公司—A股	25,400	103,632	0.16
中遠海運能源運輸股份有限公司—A股	9,800	66,738	0.10
中遠海運控股股份有限公司—A股	24,800	129,952	0.20
中國中車股份有限公司—A股	73,515	718,242	1.09
中船海洋與防務裝備股份有限公司—A股	2,200	65,340	0.10
文投控股股份有限公司—A股	2,400	52,920	0.08
中山大學達安基因股份有限公司—A股	2,490	57,768	0.09
大連港股份有限公司—A股	27,430	76,804	0.12

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
中國大連天神娛樂有限公司—A股	600	41,496	0.06
大秦鐵路股份有限公司—A股	48,216	341,369	0.52
大唐電信科技股份有限公司—A股	3,500	55,545	0.08
曙光信息產業股份有限公司—A股	2,200	61,204	0.09
東華軟體股份公司—A股	5,400	125,820	0.19
神州數碼集團股份有限公司—A股	1,400	31,248	0.05
神州數碼信息服務股份有限公司—A股	1,700	36,091	0.05
多氟多化工股份有限公司—A股	1,800	49,122	0.07
東阿阿膠股份有限公司—A股	2,100	113,127	0.17
東方電氣股份有限公司—A股	7,000	75,530	0.11
東興證券股份有限公司—A股	7,500	150,450	0.23
東旭光電科技股份有限公司—A股	15,700	176,782	0.27
鵬博士電信傳媒集團股份有限公司—A股	4,900	107,457	0.16
深圳市怡亞通供應鏈股份有限公司—A股	7,000	76,020	0.12
光大證券股份有限公司—A股	12,100	193,479	0.29
方大炭素新材料科技股份有限公司—A股	6,300	58,338	0.09
一汽轎車股份有限公司—A股	5,600	60,872	0.09
烽火通信科技股份有限公司—A股	3,100	78,151	0.12
金融街控股股份有限公司—A股	10,500	108,150	0.16
方正證券股份有限公司—A股	25,100	190,760	0.29
福建新大陸電腦股份有限公司—A股	3,500	68,005	0.10
福建聖農發展股份有限公司—A股	4,000	84,880	0.13
新城控股集團股份有限公司—A股	7,300	85,775	0.13
福耀玻璃工業集團股份有限公司—A股	6,993	130,280	0.20
北海銀河生物產業投資股份有限公司—A股	3,700	58,608	0.09
甘肅剛泰控股(集團)股份有限公司—A股	10,000	164,200	0.25
協鑫集成科技股份有限公司—A股	9,100	50,232	0.08
國電電力發展股份有限公司—A股	62,400	197,808	0.30
格林美股份有限公司—A股	6,200	40,610	0.06
金地(集團)股份有限公司—A股	15,600	202,176	0.31
洲際油氣股份有限公司—A股	7,400	72,668	0.11
廣發證券股份有限公司—A股	19,200	323,712	0.49
跨境通寶電子商務股份有限公司—A股	3,800	69,540	0.11
廣聯達科技股份有限公司—A股	4,200	61,320	0.09
歌爾聲學股份有限公司—A股	4,800	127,296	0.19
珠海格力電器股份有限公司—A股	9,900	243,738	0.37
廣州廣電運通金融電子股份有限公司—A股	5,450	72,376	0.11
廣東省廣告集團股份有限公司—A股	4,750	65,503	0.10
廣東錦龍發展股份有限公司—A股	2,600	60,944	0.09
廣東海大集團股份有限公司—A股	5,200	78,260	0.12
廣東東陽光科技控股股份有限公司—A股	9,100	66,339	0.10

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
廣匯能源股份有限公司—A股	19,100	89,197	0.13
廣深鐵路股份有限公司—A股	20,300	102,921	0.16
廣西梧州中恒集團股份有限公司—A股	12,600	57,708	0.09
廣州白雲山醫藥集團股份有限公司—A股	4,200	100,716	0.15
廣州海格通信集團股份有限公司—A股	7,500	87,375	0.13
貴州百靈企業集團製藥股份有限公司—A股	4,900	92,806	0.14
國信證券股份有限公司—A股	13,500	209,925	0.32
國泰君安證券股份有限公司—A股	25,200	468,468	0.71
國軒高科股份有限公司	2,600	80,574	0.12
國元證券股份有限公司—A股	7,000	139,300	0.21
海南航空股份有限公司—A股	57,700	188,102	0.28
海南海藥股份有限公司—A股	4,200	53,382	0.08
海通證券股份有限公司—A股	27,100	426,825	0.65
杭州巨星科技股份有限公司—A股	3,700	57,720	0.09
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	20,390	485,486	0.73
杭州聯絡互動信息科技股份有限公司—A股	6,350	88,709	0.13
杭州老闆電器股份有限公司—A股	2,400	88,320	0.13
大族激光科技產業集團股份有限公司—A股	3,500	79,100	0.12
哈爾濱醫藥集團股份有限公司—A股	8,400	69,468	0.11
哈藥集團股份有限公司—A股	8,600	73,788	0.11
合肥美亞光電技術股份有限公司—A股	1,600	33,856	0.05
黑龍江北大荒農業股份有限公司—A股	6,300	76,860	0.12
河南平高電氣股份有限公司—A股	4,200	65,604	0.10
河南雙匯投資發展股份有限公司—A股	9,300	194,649	0.29
恒康醫療集團股份有限公司—A股	5,200	62,296	0.09
江蘇亨通光電股份有限公司—A股	2,700	50,382	0.08
河鋼股份有限公司—A股	38,500	128,590	0.19
青島海信電器股份有限公司—A股	3,800	65,056	0.10
鴻達興業股份有限公司—A股	8,584	63,007	0.10
華電國際電力股份有限公司—A股	24,600	121,770	0.18
華東醫藥股份有限公司—A股	1,600	115,312	0.17
華蘭生物工程股份有限公司—A股	3,176	113,542	0.17
華能國際電力股份有限公司—A股	21,900	154,395	0.23
華邦生命健康股份有限公司—A股	7,700	69,839	0.11
華泰證券股份有限公司—A股	18,100	323,266	0.49
華聞傳媒投資集團股份有限公司—A股	7,700	86,933	0.13
華夏銀行股份有限公司—A股	33,975	368,629	0.56
華域汽車系統股份有限公司—A股	9,600	153,120	0.23
天茂實業集團股份有限公司—A股	11,300	86,445	0.13
湖北能源集團股份有限公司—A股	19,600	89,768	0.14
人福醫藥集團股份有限公司—A股	3,700	73,815	0.11

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
湖南大康國際農業食品股份有限公司—A股	15,840	56,074	0.08
湖南江南紅箭股份有限公司—A股	3,432	51,137	0.08
湖南電廣傳媒股份有限公司—A股	4,900	70,511	0.11
恒生電子股份有限公司—A股	2,100	98,994	0.15
海能達通信股份有限公司—A股	5,800	76,618	0.12
科大訊飛股份有限公司—A股	4,000	108,360	0.16
中國工商銀行—A股	172,800	762,048	1.15
興業銀行股份有限公司—A股	61,600	994,224	1.50
興業證券股份有限公司—A股	22,140	169,371	0.26
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司—A股	92,800	258,912	0.39
內蒙古君正能源化工股份有限公司—A股	25,200	117,180	0.18
內蒙古蒙電華能熱電股份有限公司—A股	21,000	64,680	0.10
內蒙古伊利實業集團股份有限公司—A股	19,654	345,910	0.52
浪潮電子信息產業股份有限公司—A股	3,500	74,200	0.11
江蘇必康製藥股份有限公司—A股	2,200	59,510	0.09
江蘇省廣電有線信息網絡股份有限公司—A股	8,460	95,598	0.14
江蘇恒瑞醫藥股份有限公司—A股	7,815	355,582	0.54
江蘇鳳凰出版傳媒股份有限公司—A股	7,700	80,619	0.12
江蘇保千里視像科技集團股份有限公司—A股	8,400	111,216	0.17
江蘇沙鋼股份有限公司—A股	10,000	161,200	0.24
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	4,200	296,520	0.45
江蘇魚躍醫療設備股份有限公司—A股	2,100	65,142	0.10
江蘇中南建設集團—A股	10,200	106,080	0.16
江蘇中天科技股份有限公司—A股	8,950	94,243	0.14
江蘇綜藝股份有限公司—A股	4,400	45,540	0.07
江西銅業股份有限公司—A股	6,451	107,925	0.16
江西贛鋒鋰業股份有限公司—A股	2,600	68,926	0.10
江西特種電機股份有限公司—A股	4,200	50,106	0.08
際華集團股份有限公司—A股	12,400	114,204	0.17
吉林敖東藥業集團股份有限公司—A股	2,500	77,475	0.12
金堆城鋁業股份有限公司—A股	9,800	74,970	0.11
金科地產集團股份有限公司—A股	11,600	60,784	0.09
吉視傳媒股份有限公司—A股	11,200	46,928	0.07
冀中能源股份有限公司—A股	12,600	84,924	0.13
健康元藥業集團股份有限公司—A股	5,600	55,608	0.08
九州通醫藥集團股份有限公司—A股	3,700	76,738	0.12
康得新複合材料集團股份有限公司—A股	11,284	215,637	0.33
康美藥業股份有限公司—A股	15,980	285,243	0.43
金正大生態工程集團股份有限公司—A股	11,200	88,480	0.13
金發科技股份有限公司—A股	9,100	70,798	0.11
愷英網絡股份有限公司—A股	1,700	57,052	0.09

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
昆吾九鼎投資控股股份有限公司—A股	1,000	46,060	0.07
貴州茅台酒股份有限公司—A股	4,124	1,378,035	2.09
利歐集團股份有限公司—A股	5,300	84,535	0.13
遼寧成大股份有限公司—A股	5,600	100,576	0.15
魯信創業投資集團—A股	2,200	49,764	0.08
立訊精密工業股份有限公司—A股	7,200	149,400	0.23
瀘州老窖股份有限公司—A股	4,900	161,700	0.24
馬鞍山鋼鐵股份有限公司—A股	21,700	61,411	0.09
梅花生物科技集團股份有限公司—A股	7,000	45,640	0.07
美年大健康產業控股股份有限公司—A股	5,900	77,762	0.12
中國冶金科工股份有限公司—A股	44,600	207,836	0.31
美的集團股份有限公司—A股	20,850	587,344	0.89
五礦發展股份有限公司—A股	4,200	63,966	0.10
牧原食品股份有限公司—A股	3,700	86,136	0.13
南京新街口百貨商店股份有限公司—A股	2,900	108,083	0.16
國電南瑞科技股份有限公司—A股	7,400	123,062	0.19
北京四維圖新科技股份有限公司—A股	3,300	63,855	0.10
東軟集團股份有限公司—A股	4,200	82,572	0.12
新華人壽保險股份有限公司—A股	5,500	240,790	0.36
新希望六和股份有限公司—A股	12,200	98,210	0.15
寧波均勝電子股份有限公司—A股	1,900	62,871	0.10
寧波舟山港股份有限公司—A股	30,800	155,848	0.24
北方導航控制技術股份有限公司—A股	5,600	73,024	0.11
東北證券股份有限公司—A股	8,400	103,824	0.16
泛海控股股份有限公司—A股	12,400	115,196	0.17
海洋石油工程股份有限公司—A股	13,200	97,416	0.15
奧瑞金包裝股份有限公司—A股	8,400	72,576	0.11
東方證券股份有限公司—A股	16,400	254,692	0.39
華東能源股份有限公司—A股	5,600	69,384	0.11
太平洋證券股份有限公司—A股	21,800	112,270	0.17
龐大汽貿集團股份有限公司—A股	23,800	65,926	0.10
人民網股份有限公司—A股	4,200	74,172	0.11
中國石油天然氣股份有限公司—A股	33,700	267,915	0.41
平安銀行股份有限公司—A股	57,420	522,522	0.79
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	35,500	1,257,765	1.90
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	40,100	366,113	0.55
中國電力建設集團有限公司—A股	31,400	227,964	0.35
青島海爾股份有限公司—A股	18,800	185,744	0.28
青島漢纜股份有限公司—A股	11,900	51,170	0.08
青海鹽湖工業股份有限公司—A股	5,600	106,792	0.16
瑞康醫藥股份有限公司—A股	1,400	45,430	0.07

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
榮盛房地產發展股份有限公司—A股	15,200	119,320	0.18
上海汽車集團股份有限公司—A股	24,004	562,894	0.85
三安光電股份有限公司—A股	12,540	167,911	0.25
三一重工股份有限公司—A股	24,600	150,060	0.23
國投安信股份有限公司—A股	8,600	134,246	0.20
國投電力控股股份有限公司—A股	20,400	136,068	0.21
國海證券股份有限公司—A股	12,550	87,473	0.13
海虹企業(控股)股份有限公司—A股	3,100	130,355	0.20
陝西省國際信託股份有限公司—A股	9,300	69,564	0.11
山東黃金礦業股份有限公司—A股	5,700	208,107	0.31
山東鋼鐵集團有限公司—A股	20,300	50,750	0.08
山東玲瓏輪胎股份有限公司—A股	1,800	48,402	0.07
山東南山鋁業股份有限公司—A股	26,450	81,731	0.12
上海二三四五網絡控股集團股份有限公司—A股	5,600	63,392	0.10
上海愛建集團股份有限公司—A股	3,700	45,917	0.07
上海百聯集團股份有限公司—A股	5,539	79,540	0.12
上海建工集團股份有限公司—A股	21,960	103,871	0.16
上海大眾公用事業(集團)股份有限公司—A股	9,100	54,691	0.08
上海大智慧股份有限公司—A股	4,700	35,626	0.05
上海電氣集團總公司—A股	47,500	422,275	0.64
上海電力股份有限公司—A股	7,100	86,194	0.13
上海復星醫藥(集團)股份有限公司—A股	5,991	138,632	0.21
上海國際機場股份有限公司—A股	3,294	87,357	0.13
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	22,500	115,200	0.17
上海家化聯合股份有限公司—A股	2,100	56,931	0.09
上海錦江國際酒店(集團)股份有限公司—A股	1,700	50,082	0.08
上海金橋出口加工區開發股份有限公司—A股	3,100	57,536	0.09
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司—A股	5,860	129,682	0.20
上海機電股份有限公司—A股	2,800	54,656	0.08
上海東方明珠新媒體股份有限公司—A股	8,861	206,461	0.31
上海醫藥集團股份有限公司—A股	5,700	111,492	0.17
上海浦東發展銀行—A股	70,710	1,146,209	1.73
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	10,580	244,292	0.37
上海城投控股股份有限公司—A股	10,400	211,536	0.32
上海隧道工程股份有限公司—A股	11,200	123,312	0.19
上海外高橋保稅區開發股份有限公司—A股	2,800	55,272	0.08
上海豫園旅遊商城股份有限公司—A股	4,900	55,958	0.08
上海張江高科技園區開發股份有限公司—A股	5,300	93,916	0.14
山西潞安環保能源開發股份有限公司—A股	10,500	84,525	0.13
山西證券股份有限公司—A股	8,700	104,574	0.16
山西太鋼不銹鋼股份有限公司—A股	15,800	62,252	0.09
山西西山煤電股份有限公司—A股	11,200	94,752	0.14

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
申能股份有限公司—A股	16,800	98,616	0.15
申萬宏源集團股份有限公司—A股	65,100	406,875	0.62
深圳市農產品股份有限公司—A股	6,300	77,931	0.12
深圳市愛施德股份有限公司—A股	2,300	33,879	0.05
深圳能源集團股份有限公司—A股	12,100	83,127	0.13
深圳市飛馬國際供應鏈股份有限公司—A股	3,760	69,372	0.10
深圳市海普瑞藥業股份有限公司—A股	3,240	59,033	0.09
深圳市金證科技股份有限公司—A股	2,800	70,364	0.11
深圳歐菲光科技股份有限公司—A股	3,500	119,980	0.18
深圳華僑城股份有限公司—A股	26,000	180,700	0.27
深圳信立泰藥業股份有限公司—A股	3,500	102,340	0.16
深圳世聯行地產顧問股份有限公司—A股	7,240	55,024	0.08
深圳市鹽田港股份有限公司—A股	7,000	49,910	0.08
深圳市中金嶺南有色金屬股份有限公司—A股	7,700	85,855	0.13
石家莊以嶺藥業股份有限公司—A股	4,200	72,408	0.11
四川長虹電器股份有限公司—A股	16,800	70,224	0.11
四川川投能源股份有限公司—A股	13,400	116,580	0.18
四川和邦生物科技股份有限公司—A股	8,600	44,032	0.07
四川科倫藥業股份有限公司—A股	4,900	78,988	0.12
中化國際(控股)股份有限公司—A股	7,700	89,782	0.14
北京中科金財科技股份有限公司—A股	900	38,844	0.06
國金證券股份有限公司—A股	9,200	119,876	0.18
中國石化上海石油化工股份有限公司—A股	17,300	111,412	0.17
中外運空運發展股份有限公司—A股	3,500	57,890	0.09
華銳風電科技(集團)股份有限公司—A股	18,200	42,588	0.06
東吳證券股份有限公司—A股	9,800	130,046	0.20
西南證券股份有限公司—A股	16,900	120,497	0.18
春秋航空股份有限公司—A股	1,500	55,110	0.08
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	30,400	348,080	0.53
蘇寧環球股份有限公司—A股	10,300	88,889	0.13
陽光城集團股份有限公司—A股	14,200	79,094	0.12
索菲亞家居股份有限公司—A股	1,200	64,992	0.10
蘇州金螳螂建築裝飾股份有限公司—A股	9,650	94,473	0.14
蘇州勝利精密製造科技股份有限公司—A股	10,250	84,767	0.13
台海瑪努爾核電設備股份有限公司—A股	1,400	75,068	0.11
太極計算機股份有限公司—A股	1,400	42,854	0.06
唐山港集團股份有限公司—A股	14,880	59,669	0.09
天士力製藥集團股份有限公司—A股	3,800	157,662	0.24
中山達華智能科技股份有限公司—A股	3,200	52,256	0.08
特變電工股份有限公司—A股	10,000	91,300	0.14
TCL集團股份有限公司—A股	40,300	132,990	0.20
泰禾集團股份有限公司—A股	3,800	67,222	0.10

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
天地科技股份有限公司—A股	12,600	62,622	0.09
天津港股份有限公司—A股	6,300	63,504	0.10
天津天海投資發展股份有限公司—A股	5,600	46,816	0.07
天津中環半導體股份有限公司—A股	18,200	150,514	0.23
天馬微電子股份有限公司—A股	8,400	158,088	0.24
天齊鋁業股份有限公司—A股	3,400	110,330	0.17
通鼎互聯信息股份有限公司—A股	2,600	40,404	0.06
通化東寶藥業股份有限公司—A股	4,060	89,036	0.13
通化金馬藥業集團股份有限公司—A股	3,100	54,436	0.08
銅陵有色金屬集團控股有限公司—A股	34,300	105,644	0.16
清華同方股份有限公司—A股	10,500	145,425	0.22
清華紫光股份有限公司—A股	1,100	63,129	0.10
青島啤酒股份有限公司—A股	2,000	58,880	0.09
啟迪桑德環境資源股份有限公司—A股	2,800	92,344	0.14
紫光國芯股份有限公司—A股	2,200	72,468	0.11
眾信旅遊集團股份有限公司—A股	2,400	37,320	0.06
啟明星辰信息技術集團股份有限公司—A股	2,800	58,212	0.09
視覺(中國)文化發展股份有限公司—A股	2,100	40,026	0.06
萬達電影院線股份有限公司—A股	3,400	183,838	0.28
萬華化學集團股份有限公司—A股	7,700	165,781	0.25
萬向錢潮股份有限公司—A股	8,400	111,384	0.17
濰柴動力股份有限公司—A股	8,900	88,644	0.13
無錫威孚高科技集團股份有限公司—A股	3,000	67,320	0.10
西部礦業股份有限公司—A股	8,400	65,772	0.10
西部證券股份有限公司—A股	8,800	182,776	0.28
成都衛士通信息產業股份有限公司—A股	1,400	43,988	0.07
永泰能源股份有限公司—A股	24,600	98,646	0.15
物產中大集團股份有限公司—A股	8,090	83,570	0.13
武漢鋼鐵股份有限公司—A股	35,300	120,373	0.18
蕪湖順榮三七互娛網絡科技股份有限公司—A股	4,900	80,360	0.12
宜賓五糧液股份有限公司—A股	12,100	417,208	0.63
徐工集團工程機械股份有限公司—A股	21,400	72,332	0.11
廈門建發股份有限公司—A股	10,050	107,535	0.16
廈門鎢業股份有限公司—A股	3,500	77,070	0.12
西安隆基硅材料股份有限公司—A股	6,300	84,357	0.13
新湖中寶股份有限公司—A股	25,200	104,832	0.16
新疆金風科技股份有限公司—A股	6,800	116,348	0.18
新疆中泰化學股份有限公司—A股	4,600	55,660	0.08
新興鑄管股份有限公司—A股	10,500	54,285	0.08
內蒙古西水創業股份有限公司—A股	2,400	46,032	0.07
許繼電氣股份有限公司—A股	3,500	63,525	0.10

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.59%)(續)	持股量	公平價值 人民幣	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.59%)(續)</b>			
<b>中國(99.59%)(續)</b>			
陽泉煤業(集團)股份有限公司—A股	8,400	56,532	0.09
煙台傑瑞石油服務集團股份有限公司—A股	2,600	52,780	0.08
億帆醫藥股份有限公司—A股	4,300	65,747	0.10
宜華生活科技股份有限公司—A股	5,600	59,640	0.09
營口港務股份有限公司—A股	15,200	52,744	0.08
永輝超市股份有限公司—A股	29,400	144,354	0.22
用友網絡科技股份有限公司—A股	4,500	93,690	0.14
雅戈爾集團股份有限公司—A股	8,400	117,432	0.18
遊族網絡股份有限公司—A股	2,100	55,545	0.08
袁隆平農業高科技股份有限公司—A股	4,200	90,006	0.14
雲南白藥集團股份有限公司—A股	7,300	555,895	0.84
雲南馳宏鋅鎳股份有限公司—A股	15,000	105,450	0.16
雲南錫業股份有限公司—A股	3,200	41,984	0.06
漳州片仔癀藥業股份有限公司—A股	2,100	96,159	0.15
浙報傳媒集團股份有限公司—A股	4,200	74,172	0.11
浙江中國小商品城集團股份有限公司—A股	19,300	166,945	0.25
浙江正泰電器股份有限公司—A股	4,437	88,740	0.13
浙江大華技術股份有限公司—A股	8,700	119,016	0.18
浙江華海藥業股份有限公司—A股	3,700	81,511	0.12
浙江巨化股份有限公司—A股	6,208	65,681	0.10
浙江龍盛集團股份有限公司—A股	10,100	93,021	0.14
浙江新和成股份有限公司—A股	3,000	58,800	0.09
浙江萬豐奧威汽輪股份有限公司—A股	5,600	110,656	0.17
浙江萬馬股份有限公司—A股	3,500	52,605	0.08
浙江亞廈裝飾股份有限公司—A股	3,800	40,204	0.06
浙江浙能電力股份有限公司—A股	30,300	164,529	0.25
鄭州宇通客車股份有限公司—A股	7,763	152,077	0.23
中弘控股股份有限公司—A股	15,400	40,656	0.06
中金黃金股份有限公司—A股	12,210	147,619	0.22
中南紅文化集團股份有限公司—A股	3,200	48,032	0.07
中山大洋電機股份有限公司—A股	6,300	54,369	0.08
中天城投集團股份有限公司—A股	16,600	115,038	0.17
紫金礦業集團股份有限公司—A股	49,600	165,664	0.25
中聯重科股份有限公司—A股	22,400	101,696	0.15
中興通訊股份有限公司—A股	11,876	189,422	0.29
投資總額		65,803,015	99.59
其他資產淨值		269,123	0.41
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		66,072,138	100.00
投資總額(按成本)		62,336,669	

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
航天工業發展股份有限公司-A股	-	9,100	-	-	9,100
中國農業銀行-A股	-	536,700	-	285,000	251,700
中國國際航空股份有限公司-A股	-	37,700	-	24,200	13,500
航天信息股份有限公司-A股	-	8,500	3,400	5,400	6,500
奧飛娛樂股份有限公司-A股	-	9,100	-	4,500	4,600
中國鋁業股份有限公司-A股	-	74,100	-	38,100	36,000
鞍鋼股份有限公司-A股	-	33,776	-	19,600	14,176
安徽海螺水泥股份有限公司-A股	-	30,600	-	17,100	13,500
安徽江淮汽車股份有限公司-A股	-	10,400	-	4,800	5,600
安徽新華傳媒股份有限公司-A股	-	4,300	-	-	4,300
安徽中鼎密封件股份有限公司-A股	-	7,800	-	3,600	4,200
安信信託股份有限公司-A股	-	11,700	-	5,400	6,300
北極光光電有限公司-A股	-	1,700	-	-	1,700
中航動力控制股份有限公司-A股	-	7,702	-	3,600	4,102
中航飛機股份有限公司-A股	-	18,200	-	9,700	8,500
中航動力股份有限公司-A股	-	16,300	-	10,300	6,000
中航航空高科技股份有限公司-A股	-	8,700	-	4,200	4,500
中航投資控股股份有限公司-A股	-	29,900	29,900	31,800	28,000
中航工業機電系統股份有限公司-A股	-	6,300	3,150	4,200	5,250
中航重機股份有限公司-A股	-	5,200	-	5,200	-
中航直升機有限責任公司-A股	-	3,900	-	1,800	2,100
中航光電科技股份有限公司-A股	-	3,900	-	1,800	2,100
北京銀行股份有限公司-A股	-	89,100	16,980	55,300	50,780
中國銀行股份有限公司-A股	-	471,900	-	314,100	157,800
交通銀行股份有限公司-A股	-	269,100	-	143,200	125,900
貴陽銀行股份有限公司-A股	-	4,200	-	-	4,200
江蘇銀行股份有限公司-A股	-	8,300	-	-	8,300
南京銀行股份有限公司-A股	-	25,400	20,320	26,800	18,920
寧波銀行股份有限公司-A股	-	31,000	-	17,500	13,500
寶山鋼鐵股份有限公司-A股	-	74,043	-	35,600	38,443
北京金隅股份有限公司-A股	-	21,500	21,500	19,800	23,200
北京首創股份有限公司-A股	-	15,600	15,600	14,400	16,800
北京首都開發股份有限公司-A股	-	19,091	-	10,100	8,991
北京大北農科技集團股份有限公司-A股	-	18,200	9,100	12,600	14,700
北京歌華有線電視網絡股份有限公司-A股	-	12,000	-	8,200	3,800
北京京能電力股份有限公司-A股	-	26,000	-	26,000	-
北京金一文化發展股份有限公司-A股	-	3,900	-	3,900	-
北新集團建材股份有限公司-A股	-	9,100	-	4,000	5,100
北京東方園林股份有限公司-A股	-	6,500	9,750	7,300	8,950
北京中長石基信息技術股份有限公司-A股	-	2,560	5,120	4,700	2,980
北京首鋼股份有限公司-A股	-	29,600	-	14,200	15,400

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
北京雙鷺藥業股份有限公司—A股	-	5,200	-	3,300	1,900
北京國電清新環保技術股份有限公司—A股	-	9,800	-	5,800	4,000
北京天壇生物製品股份有限公司—A股	-	1,100	-	-	1,100
北京同仁堂股份有限公司—A股	-	9,100	-	5,000	4,100
北京城建投資發展股份有限公司—A股	-	13,400	-	8,000	5,400
北京信威通信技術股份有限公司—A股	-	19,200	-	9,000	10,200
北京燕京啤酒股份有限公司—A股	-	19,500	-	9,000	10,500
北京中科三環高技術股份有限公司—A股	-	7,800	-	7,800	-
貝因美嬰童食品股份有限公司—A股	-	6,500	-	6,500	-
北汽福田汽車股份有限公司—A股	-	22,100	22,100	20,400	23,800
京東方科技集團股份有限公司—A股	-	228,800	-	115,700	113,100
渤海金控投資股份有限公司—A股	-	41,600	-	6,400	35,200
光明乳業股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
比亞迪股份有限公司—A股	-	13,300	-	7,300	6,000
瑞茂通供應鏈管理股份有限公司—A股	-	5,200	-	5,200	-
安徽華信國際控股股份有限公司—A股	-	18,700	-	10,800	7,900
長江證券股份有限公司—A股	-	32,500	-	15,000	17,500
長園集團股份有限公司—A股	-	7,800	1,560	6,000	3,360
成都三泰控股集團股份有限公司—A股	-	6,500	3,250	4,300	5,450
成都市興蓉環境股份有限公司—A股	-	19,500	-	9,000	10,500
航天時代電子技術股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,000	3,500
中航航空電子系統股份有限公司—A股	-	10,400	-	6,300	4,100
中國寶安集團股份有限公司—A股	-	10,400	3,640	6,600	7,440
中工國際工程股份有限公司—A股	-	5,200	1,040	3,000	3,240
中信銀行股份有限公司—A股	-	57,200	-	37,400	19,800
中國中煤能源股份有限公司—A股	-	41,600	-	41,600	-
中國交通建設股份有限公司—A股	-	26,000	-	16,700	9,300
中國建設銀行股份有限公司—A股	-	65,000	-	34,700	30,300
中國船舶工業股份有限公司—A股	-	9,100	-	4,200	4,900
中國東方航空股份有限公司—A股	-	57,000	-	30,900	26,100
中國光大銀行股份有限公司—A股	-	267,800	-	138,700	129,100
中國電影股份有限公司—A股	-	6,200	-	-	6,200
中國第一重型機械集團公司—A股	-	44,200	-	21,300	22,900
華夏幸福基業投資開發股份有限公司—A股	-	21,488	-	13,500	7,988
中國葛洲壩集團股份有限公司—A股	-	31,200	-	17,000	14,200
廣匯汽車服務股份公司—A股	-	15,100	-	-	15,100
海南天然橡膠產業集團股份有限公司—A股	-	26,000	-	12,000	14,000
神州高鐵技術股份有限公司—A股	-	15,200	-	7,200	8,000
中國國旅股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,000	3,500
中國國際海運集裝箱(集團)股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
中國巨石股份有限公司—A股	-	15,300	-	7,200	8,100

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
中國人壽保險股份有限公司-A股	-	35,725	-	26,100	9,625
招商銀行-A股	-	144,983	-	77,500	67,483
招商局能源運輸股份有限公司-A股	-	35,100	-	19,100	16,000
招商證券股份有限公司-A股	-	44,629	-	25,500	19,129
招商局蛇口工業區控股股份有限公司-A股	-	49,600	-	28,300	21,300
五礦稀土股份有限公司-A股	-	6,500	-	6,500	-
中國民生銀行-A股	-	205,500	-	110,100	95,400
洛陽樂川鋁業集團股份有限公司-A股	-	56,600	-	26,300	30,300
國藥集團一致藥業股份有限公司-A股	-	2,400	-	1,500	900
中國化學工程股份有限公司-A股	-	33,800	-	19,400	14,400
中國核能電力股份有限公司-A股	-	92,700	-	50,800	41,900
中國軟件與技術服務股份有限公司-A股	-	3,900	-	3,900	-
中國有色金屬建設股份有限公司-A股	-	9,100	7,400	11,200	5,300
中國北方稀土(集團)高科技股份有限公司-A股	-	24,700	-	12,300	12,400
中國核工業建設集團公司-A股	-	3,800	-	-	3,800
中海油田服務股份有限公司-A股	-	13,000	-	13,000	-
中國太平洋保險(集團)股份有限公司-A股	-	46,200	-	25,900	20,300
中國石油化工股份有限公司-A股	-	162,500	-	79,600	82,900
中國鐵建股份有限公司-A股	-	76,400	-	42,200	34,200
中鐵二局股份有限公司-A股	-	10,400	-	4,800	5,600
中國中鐵股份有限公司-A股	-	124,722	-	75,300	49,422
華潤三九醫藥股份有限公司-A股	-	6,500	-	3,000	3,500
中安消股份有限公司-A股	-	7,700	-	3,000	4,700
中國神華能源股份有限公司-A股	-	45,500	-	31,400	14,100
中國船舶重工股份有限公司-A股	-	123,500	-	63,900	59,600
中國船舶重工集團動力股份有限公司-A股	-	7,600	-	3,600	4,000
中南出版傳媒集團股份有限公司-A股	-	11,622	-	5,400	6,222
中國南方航空股份有限公司-A股	-	46,800	-	24,900	21,900
中國東方紅衛星股份有限公司-A股	-	7,800	-	3,600	4,200
中國建築-A股	-	201,500	-	103,300	98,200
中國聯合網絡-A股	-	143,000	-	74,100	68,900
萬科企業股份有限公司-A股	-	64,500	-	33,000	31,500
中國西電電氣股份有限公司-A股	-	35,100	-	16,200	18,900
中國長江電力股份有限公司-A股	-	98,400	-	51,000	47,400
中文天地出版傳媒股份有限公司-A股	-	9,100	-	4,200	4,900
重慶長安汽車股份有限公司-A股	-	24,613	-	13,000	11,613
重慶市迪馬實業股份有限公司-A股	-	23,900	-	15,800	8,100
中信國安信息產業股份有限公司-A股	-	10,400	15,600	12,000	14,000
中信重工機械股份有限公司-A股	-	23,400	-	10,800	12,600
中信證券股份有限公司-A股	-	71,900	-	38,900	33,000

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
中儲發展股份有限公司—A股	-	20,100	-	14,200	5,900
中糧地產(集團)股份有限公司—A股	-	15,400	-	10,700	4,700
中糧屯河股份有限公司—A股	-	14,300	-	7,600	6,700
中遠海運發展股份有限公司—A股	-	53,300	-	27,900	25,400
中遠海運能源運輸股份有限公司—A股	-	18,200	-	8,400	9,800
中遠海運控股股份有限公司—A股	-	50,700	-	25,900	24,800
中遠海運特種運輸股份有限公司—A股	-	11,700	-	11,700	-
中國中車股份有限公司—A股	-	162,715	-	89,200	73,515
中船海洋與防務裝備股份有限公司—A股	-	5,200	-	3,000	2,200
文投控股股份有限公司—A股	-	2,400	-	-	2,400
中山大學達安基因股份有限公司—A股	-	3,900	390	1,800	2,490
大連港股份有限公司—A股	-	22,100	28,730	23,400	27,430
大連天神娛樂股份有限公司—A股	-	600	-	-	600
大秦鐵路股份有限公司—A股	-	100,016	-	51,800	48,216
大唐電信科技股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,000	3,500
曙光信息產業股份有限公司—A股	-	2,000	2,000	1,800	2,200
東華軟體股份有限公司—A股	-	10,200	-	4,800	5,400
神州數碼集團股份有限公司—A股	-	1,400	-	-	1,400
神州數碼信息服務股份有限公司—A股	-	1,700	-	-	1,700
多氟多化工股份有限公司—A股	-	4,300	-	2,500	1,800
東阿阿膠股份有限公司—A股	-	3,900	-	1,800	2,100
東方電氣股份有限公司—A股	-	13,000	-	6,000	7,000
東興證券股份有限公司—A股	-	13,700	-	6,200	7,500
東旭光電科技股份有限公司—A股	-	28,900	-	13,200	15,700
騰博士電信傳媒集團股份有限公司—A股	-	9,100	-	4,200	4,900
深圳市怡亞通供應鏈股份有限公司—A股	-	6,500	6,500	6,000	7,000
光大證券股份有限公司—A股	-	29,300	-	17,200	12,100
方大炭素新材料科技股份有限公司—A股	-	11,700	-	5,400	6,300
一汽轎車股份有限公司—A股	-	10,400	-	4,800	5,600
烽火通信科技股份有限公司—A股	-	7,600	-	4,500	3,100
金融街控股股份有限公司—A股	-	25,000	-	14,500	10,500
方正證券股份有限公司—A股	-	55,900	-	30,800	25,100
福建龍淨環保股份有限公司—A股	-	7,800	-	7,800	-
福建新大陸電腦股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,000	3,500
福建聖農發展股份有限公司—A股	-	7,000	-	3,000	4,000
新城控股集團股份有限公司—A股	-	13,300	-	6,000	7,300
福耀玻璃工業集團股份有限公司—A股	-	12,993	-	6,000	6,993
北海銀河生物產業投資股份有限公司—A股	-	7,200	-	3,500	3,700
甘肅剛泰控股(集團)股份有限公司—A股	-	10,000	-	-	10,000
甘肅亞盛實業(集團)股份有限公司—A股	-	13,000	-	13,000	-
協鑫集成科技股份有限公司—A股	-	16,900	-	7,800	9,100

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
國電電力發展股份有限公司—A股	-	132,600	-	70,200	62,400
格林美股份有限公司—A股	-	6,200	-	-	6,200
金地(集團)股份有限公司—A股	-	33,200	-	17,600	15,600
洲際油氣股份有限公司—A股	-	23,600	-	16,200	7,400
廣發證券股份有限公司—A股	-	47,300	-	28,100	19,200
跨境通寶電子商務股份有限公司—A股	-	3,400	3,400	3,000	3,800
廣聯達科技股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
歌爾聲學股份有限公司—A股	-	10,400	-	5,600	4,800
長城汽車股份有限公司—A股	-	27,300	-	27,300	-
珠海格力電器股份有限公司—A股	-	9,900	-	-	9,900
廣州廣電運通金融電子股份有限公司—A股	-	6,500	3,250	4,300	5,450
廣東省廣告集團股份有限公司—A股	-	6,500	1,950	3,700	4,750
廣東電力發展股份有限公司—A股	-	19,500	-	19,500	-
廣東錦龍發展股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,900	2,600
廣東海大集團股份有限公司—A股	-	10,000	-	4,800	5,200
廣東東陽光科技控股股份有限公司—A股	-	16,900	-	7,800	9,100
廣東宏大爆破股份有限公司—A股	-	3,900	-	3,900	-
廣匯能源股份有限公司—A股	-	44,500	-	25,400	19,100
廣深鐵路股份有限公司—A股	-	37,700	-	17,400	20,300
廣西梧州中恒集團股份有限公司—A股	-	23,400	-	10,800	12,600
廣州白雲山醫藥集團股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
廣州海格通信集團股份有限公司—A股	-	14,300	-	6,800	7,500
貴州百靈企業集團製藥股份有限公司—A股	-	9,100	-	4,200	4,900
貴州益佰製藥股份有限公司—A股	-	5,200	-	5,200	-
國信證券股份有限公司—A股	-	31,300	-	17,800	13,500
國泰君安證券股份有限公司—A股	-	46,600	-	21,400	25,200
國軒高科股份有限公司	-	5,700	-	3,100	2,600
國元證券股份有限公司—A股	-	13,000	-	6,000	7,000
海南航空股份有限公司—A股	-	104,800	-	47,100	57,700
海南海藥股份有限公司—A股	-	3,900	3,900	3,600	4,200
海寧中國皮革城股份有限公司—A股	-	7,800	-	7,800	-
海思科醫藥集團股份有限公司—A股	-	5,200	-	5,200	-
海通證券股份有限公司—A股	-	60,300	-	33,200	27,100
杭州巨星科技股份有限公司—A股	-	7,100	-	3,400	3,700
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	-	30,527	15,263	25,400	20,390
杭州聯絡互動信息科技股份有限公司—A股	-	3,900	5,850	3,400	6,350
杭州老闆電器股份有限公司—A股	-	3,600	1,800	3,000	2,400
大族激光科技產業集團股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,000	3,500
哈爾濱醫藥集團股份有限公司—A股	-	5,200	10,400	7,200	8,400
哈藥集團股份有限公司—A股	-	16,200	3,900	11,500	8,600
合肥美亞光電技術股份有限公司—A股	-	5,200	-	3,600	1,600

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
黑龍江北大荒農業股份有限公司-A股	-	11,700	-	5,400	6,300
河南平高電氣股份有限公司-A股	-	7,800	-	3,600	4,200
河南雙匯投資發展股份有限公司-A股	-	25,400	-	16,100	9,300
恒康醫療集團股份有限公司-A股	-	10,000	-	4,800	5,200
江蘇亨通光電股份有限公司-A股	-	2,700	-	-	2,700
河鋼股份有限公司-A股	-	71,500	-	33,000	38,500
青島海信電器股份有限公司-A股	-	9,100	-	5,300	3,800
鴻達興業股份有限公司-A股	-	6,500	9,884	7,800	8,584
華電國際電力股份有限公司-A股	-	54,600	-	30,000	24,600
華東醫藥股份有限公司-A股	-	3,300	-	1,700	1,600
華蘭生物工程股份有限公司-A股	-	3,860	2,316	3,000	3,176
華能國際電力股份有限公司-A股	-	46,800	-	24,900	21,900
華邦生命健康股份有限公司-A股	-	14,300	-	6,600	7,700
華泰證券股份有限公司-A股	-	42,100	-	24,000	18,100
華聞傳媒投資集團股份有限公司-A股	-	14,300	-	6,600	7,700
華夏銀行股份有限公司-A股	-	84,375	-	50,400	33,975
華域汽車系統股份有限公司-A股	-	20,800	-	11,200	9,600
天茂實業集團股份有限公司-A股	-	20,900	-	9,600	11,300
湖北能源集團股份有限公司-A股	-	36,400	-	16,800	19,600
人福醫藥集團股份有限公司-A股	-	9,100	-	5,400	3,700
湖南大康國際農業食品股份有限公司-A股	-	15,600	14,040	13,800	15,840
湖南江南紅箭股份有限公司-A股	-	6,500	532	3,600	3,432
湖南電廣傳媒股份有限公司-A股	-	9,100	-	4,200	4,900
恒生電子股份有限公司-A股	-	3,900	-	1,800	2,100
海能達通信股份有限公司-A股	-	5,800	-	-	5,800
科大訊飛股份有限公司-A股	-	9,100	-	5,100	4,000
中國工商銀行-A股	-	372,700	-	199,900	172,800
興業銀行股份有限公司-A股	-	134,100	-	72,500	61,600
興業證券股份有限公司-A股	-	45,440	-	23,300	22,140
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司-A股	-	182,000	-	89,200	92,800
內蒙古君正能源化工股份有限公司-A股	-	23,400	23,400	21,600	25,200
內蒙古蒙華能熱電股份有限公司-A股	-	39,000	-	18,000	21,000
內蒙古伊利實業集團股份有限公司-A股	-	44,854	-	25,200	19,654
浪潮電子信息產業股份有限公司-A股	-	6,500	-	3,000	3,500
江蘇必康製藥股份有限公司-A股	-	2,200	-	-	2,200
江蘇省廣電有線信息網絡股份有限公司-A股	-	19,900	4,260	15,700	8,460
江蘇恒瑞醫藥股份有限公司-A股	-	16,213	2,602	11,000	7,815
江蘇宏圖高科技股份有限公司-A股	-	7,500	-	7,500	-
江蘇鳳凰出版傳媒股份有限公司-A股	-	14,300	-	6,600	7,700
江蘇保千里視像科技集團股份有限公司-A股	-	15,600	-	7,200	8,400
江蘇沙鋼股份有限公司-A股	-	13,000	-	3,000	10,000

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	-	10,800	-	6,600	4,200
江蘇魚躍醫療設備股份有限公司—A股	-	3,900	-	1,800	2,100
江蘇中南建設集團—A股	-	10,200	-	-	10,200
江蘇中天科技股份有限公司—A股	-	6,500	9,750	7,300	8,950
江蘇綜藝股份有限公司—A股	-	10,800	-	6,400	4,400
江西銅業股份有限公司—A股	-	14,251	-	7,800	6,451
江西贛鋒鋰業股份有限公司—A股	-	2,500	2,500	2,400	2,600
江西洪都航空工業股份有限公司—A股	-	5,200	-	5,200	-
江西特種電機股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
際華集團股份有限公司—A股	-	26,000	-	13,600	12,400
吉林敖東藥業集團股份有限公司—A股	-	6,500	-	4,000	2,500
金堆城鋁業股份有限公司—A股	-	18,200	-	8,400	9,800
金科地產集團股份有限公司—A股	-	37,800	-	26,200	11,600
吉視傳媒股份有限公司—A股	-	20,800	-	9,600	11,200
冀中能源股份有限公司—A股	-	23,400	-	10,800	12,600
健康元藥業集團股份有限公司—A股	-	10,400	-	4,800	5,600
九州通醫藥集團股份有限公司—A股	-	9,100	-	5,400	3,700
康得新複合材料集團股份有限公司—A股	-	11,200	11,184	11,100	11,284
康美藥業股份有限公司—A股	-	35,880	-	19,900	15,980
金正大生態工程集團股份有限公司—A股	-	10,400	10,400	9,600	11,200
金發科技股份有限公司—A股	-	16,900	-	7,800	9,100
愷英網絡股份有限公司—A股	-	2,900	-	1,200	1,700
昆吾九鼎投資控股股份有限公司—A股	-	1,000	-	-	1,000
貴州茅台酒股份有限公司—A股	-	9,324	-	5,200	4,124
利歐集團股份有限公司—A股	-	10,100	-	4,800	5,300
遼寧成大股份有限公司—A股	-	10,400	-	4,800	5,600
魯信創業投資集團—A股	-	5,200	-	3,000	2,200
立訊精密工業股份有限公司—A股	-	8,800	4,400	6,000	7,200
瀘州老窖股份有限公司—A股	-	9,100	-	4,200	4,900
馬鞍山鋼鐵股份有限公司—A股	-	40,300	-	18,600	21,700
梅花生物科技集團股份有限公司—A股	-	20,000	-	13,000	7,000
美年大健康產業控股股份有限公司—A股	-	8,800	-	2,900	5,900
中國冶金科工股份有限公司—A股	-	91,000	-	46,400	44,600
美的集團股份有限公司—A股	-	32,900	15,950	28,000	20,850
五礦發展股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
牧原食品股份有限公司—A股	-	3,900	3,900	4,100	3,700
南京新街口百貨商店股份有限公司—A股	-	6,100	-	3,200	2,900
國電南瑞科技股份有限公司—A股	-	16,900	-	9,500	7,400
北京四維圖新科技股份有限公司—A股	-	5,200	2,100	4,000	3,300
東軟集團股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
新華人壽保險股份有限公司—A股	-	16,100	-	10,600	5,500

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
新希望六和股份有限公司—A股	-	14,300	14,300	16,400	12,200
寧波均勝電子股份有限公司—A	-	4,400	-	2,500	1,900
寧波舟山港股份有限公司—A股	-	57,200	-	26,400	30,800
北方導航控制技術股份有限公司—A股	-	5,200	5,200	4,800	5,600
東北證券股份有限公司—A股	-	15,600	-	7,200	8,400
泛海控股股份有限公司—A股	-	29,000	-	16,600	12,400
海洋石油工程股份有限公司—A股	-	35,900	-	22,700	13,200
奧瑞金包裝股份有限公司—A股	-	6,500	9,100	7,200	8,400
東方證券股份有限公司—A股	-	38,100	-	21,700	16,400
華東能源股份有限公司—A股	-	7,000	5,200	6,600	5,600
太平洋證券股份有限公司—A股	-	31,200	11,400	20,800	21,800
龐大汽貿集團股份有限公司—A股	-	44,200	-	20,400	23,800
攀鋼集團鈦資源股份有限公司—A股	-	57,200	-	57,200	-
鵬欣環球資源股份有限公司—A股	-	10,400	-	10,400	-
人民網股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
中國石油天然氣股份有限公司—A股	-	72,800	-	39,100	33,700
平安銀行股份有限公司—A股	-	101,200	18,620	62,400	57,420
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	-	78,400	-	42,900	35,500
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	-	79,200	-	39,100	40,100
中國電力建設集團有限公司—A股	-	76,700	-	45,300	31,400
青島海爾股份有限公司—A股	-	47,600	-	28,800	18,800
青島漢纜股份有限公司—A股	-	22,100	-	10,200	11,900
青海鹽湖工業股份有限公司—A股	-	10,400	-	4,800	5,600
瑞康醫藥股份有限公司—A股	-	1,400	-	-	1,400
榮盛房地產發展股份有限公司—A股	-	35,600	-	20,400	15,200
日照港股份有限公司—A股	-	20,800	-	20,800	-
上海汽車集團股份有限公司—A股	-	52,604	-	28,600	24,004
三安光電股份有限公司—A股	-	16,900	10,140	14,500	12,540
三一重工股份有限公司—A股	-	50,700	-	26,100	24,600
國投安信股份有限公司—A股	-	14,800	-	6,200	8,600
國投電力控股股份有限公司—A股	-	45,500	-	25,100	20,400
國投新集能源股份有限公司—A股	-	16,900	-	16,900	-
國海證券股份有限公司—A股	-	19,500	9,750	16,700	12,550
海虹企業(控股)股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,400	3,100
陝西省國際信託股份有限公司—A股	-	17,100	-	7,800	9,300
山東黃金礦業股份有限公司—A股	-	11,500	-	5,800	5,700
山東鋼鐵集團有限公司—A股	-	37,700	-	17,400	20,300
山東玲瓏輪胎股份有限公司—A股	-	1,800	-	-	1,800
山東南山鋁業股份有限公司—A股	-	19,500	29,250	22,300	26,450
上海二三四五網絡控股集團股份有限公司—A股	-	5,200	5,200	4,800	5,600
上海愛建集團股份有限公司—A股	-	12,700	-	9,000	3,700

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
上海百聯集團股份有限公司-A股	-	10,339	-	4,800	5,539
上海建工集團股份有限公司-A股	-	33,800	6,760	18,600	21,960
上海大眾公用事業(集團)股份有限公司-A股	-	16,900	-	7,800	9,100
上海大智慧股份有限公司-A股	-	17,800	-	13,100	4,700
上海電氣集團總公司-A股	-	47,500	-	-	47,500
上海電力股份有限公司-A股	-	14,300	-	7,200	7,100
上海復星醫藥(集團)股份有限公司-A股	-	12,991	-	7,000	5,991
上海國際機場股份有限公司-A股	-	7,494	-	4,200	3,294
上海國際港務(集團)股份有限公司-A股	-	104,000	-	81,500	22,500
上海家化聯合股份有限公司-A股	-	3,900	-	1,800	2,100
上海錦江國際酒店(集團)股份有限公司-A股	-	3,500	-	1,800	1,700
上海金橋出口加工區開發股份有限公司-A股	-	6,800	-	3,700	3,100
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司-A股	-	8,200	6,560	8,900	5,860
上海機電股份有限公司-A股	-	5,200	-	2,400	2,800
上海東方明珠新媒體股份有限公司-A股	-	21,461	-	12,600	8,861
上海醫藥集團股份有限公司-A股	-	13,000	-	7,300	5,700
上海浦東發展銀行-A股	-	135,700	12,110	77,100	70,710
上海萊士血液製品股份有限公司-A股	-	16,300	5,280	11,000	10,580
上海城投控股股份有限公司-A股	-	22,400	-	12,000	10,400
上海隧道工程股份有限公司-A股	-	20,800	-	9,600	11,200
上海遊久遊戲股份有限公司-A股	-	5,200	-	5,200	-
上海外高橋保稅區開發股份有限公司-A股	-	5,200	-	2,400	2,800
上海豫園旅遊商城股份有限公司-A股	-	9,100	-	4,200	4,900
上海張江高科技園區開發股份有限公司-A股	-	13,500	-	8,200	5,300
上海振華重工(集團)股份有限公司-A股	-	18,200	-	18,200	-
山西潞安環保能源開發股份有限公司-A股	-	19,500	-	9,000	10,500
山西證券股份有限公司-A股	-	19,500	-	10,800	8,700
山西太鋼不銹鋼股份有限公司-A股	-	37,700	-	21,900	15,800
山西杏花村汾酒廠股份有限公司-A股	-	5,200	-	5,200	-
山西西山煤電股份有限公司-A股	-	20,800	-	9,600	11,200
申能股份有限公司-A股	-	31,200	-	14,400	16,800
盛和資源控股股份有限公司-A股	-	6,500	-	6,500	-
申萬宏源集團股份有限公司-A股	-	96,000	33,600	64,500	65,100
深圳市農產品股份有限公司-A股	-	11,700	-	5,400	6,300
深圳市愛施德股份有限公司-A股	-	4,500	-	2,200	2,300
深圳能源集團股份有限公司-A股	-	27,300	-	15,200	12,100
深圳市飛馬國際供應鏈股份有限公司-A股	-	5,200	1,560	3,000	3,760
深圳市海普瑞藥業股份有限公司-A股	-	3,900	2,340	3,000	3,240
深圳華強實業股份有限公司-A股	-	3,900	-	3,900	-
深圳勁嘉集團股份有限公司-A股	-	9,100	-	9,100	-
深圳市金證科技股份有限公司-A股	-	5,200	-	2,400	2,800

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
深圳歐菲光科技股份有限公司-A股	-	6,500	-	3,000	3,500
深圳華僑城股份有限公司-A股	-	54,600	-	28,600	26,000
深圳雷柏科技股份有限公司-A股	-	1,300	-	1,300	-
深圳信立泰藥業股份有限公司-A股	-	6,500	-	3,000	3,500
深圳世聯行地產顧問股份有限公司-A股	-	12,800	3,640	9,200	7,240
深圳市鹽田港股份有限公司-A股	-	13,000	-	6,000	7,000
深圳市中金嶺南有色金屬股份有限公司-A股	-	14,300	-	6,600	7,700
石家莊以嶺藥業股份有限公司-A股	-	7,800	-	3,600	4,200
四川長虹電器股份有限公司-A股	-	31,200	-	14,400	16,800
四川川投能源股份有限公司-A股	-	29,900	-	16,500	13,400
四川和邦生物科技股份有限公司	-	8,600	-	-	8,600
四川科倫藥業股份有限公司-A股	-	9,100	-	4,200	4,900
四川路橋建設集團股份有限公司-A股	-	20,800	-	20,800	-
中化國際(控股)股份有限公司-A股	-	14,300	-	6,600	7,700
北京中科金財科技股份有限公司-A股	-	2,600	-	1,700	900
國金證券股份有限公司-A股	-	20,800	-	11,600	9,200
中國石化上海石油化工股份有限公司-A股	-	40,300	-	23,000	17,300
中外運空運發展股份有限公司-A股	-	6,500	-	3,000	3,500
華銳風電科技(集團)股份有限公司-A股	-	33,800	-	15,600	18,200
東吳證券股份有限公司-A股	-	18,200	-	8,400	9,800
西南證券股份有限公司-A股	-	37,700	-	20,800	16,900
春秋航空股份有限公司-A股	-	3,900	-	2,400	1,500
蘇寧雲商集團股份有限公司-A股	-	68,400	-	38,000	30,400
蘇寧環球股份有限公司-A股	-	18,700	-	8,400	10,300
陽光城集團股份有限公司-A股	-	33,900	-	19,700	14,200
索菲亞家居股份有限公司-A股	-	3,300	-	2,100	1,200
蘇州金螳螂建築裝飾股份有限公司-A股	-	11,700	5,850	7,900	9,650
蘇州勝利精密製造科技股份有限公司-A股	-	7,700	11,550	9,000	10,250
台灣瑪努爾核電設備股份有限公司-A股	-	2,600	-	1,200	1,400
太極計算機股份有限公司-A股	-	2,600	-	1,200	1,400
太原重工股份有限公司-A股	-	16,900	-	16,900	-
唐山港集團股份有限公司-A股	-	15,600	12,480	13,200	14,880
天士力製藥集團股份有限公司-A股	-	7,800	-	4,000	3,800
中山達華智能科技股份有限公司-A股	-	8,600	-	5,400	3,200
特變電工股份有限公司-A股	-	22,100	-	12,100	10,000
TCL集團股份有限公司-A股	-	81,900	-	41,600	40,300
泰禾集團股份有限公司-A股	-	9,100	-	5,300	3,800
天地科技股份有限公司-A股	-	23,400	-	10,800	12,600
天津港股份有限公司-A股	-	11,700	-	5,400	6,300
天津海投投資發展股份有限公司-A股	-	5,600	-	-	5,600
天津中環半導體股份有限公司-A股	-	18,200	-	-	18,200

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
天馬微电子股份有限公司—A股	-	9,100	-	700	8,400
天齊鋁業股份有限公司—A股	-	6,400	-	3,000	3,400
通鼎互聯信息股份有限公司—A股	-	2,600	-	-	2,600
通化東寶藥業股份有限公司—A股	-	7,800	1,560	5,300	4,060
通化金馬藥業集團股份有限公司—A股	-	4,900	-	1,800	3,100
銅陵有色金屬集團控股有限公司—A股	-	63,700	-	29,400	34,300
清華同方股份有限公司—A股	-	19,500	-	9,000	10,500
清華紫光股份有限公司—A股	-	1,100	-	-	1,100
青島啤酒股份有限公司—A股	-	5,200	-	3,200	2,000
啟迪桑德環境資源股份有限公司—A股	-	5,200	-	2,400	2,800
紫光國芯股份有限公司—A股	-	5,500	-	3,300	2,200
眾信旅遊集團股份有限公司—A股	-	2,400	2,400	2,400	2,400
啟明星辰信息技術集團股份有限公司—A股	-	5,200	-	2,400	2,800
視聽(中國)文化發展股份有限公司—A股	-	5,200	-	3,100	2,100
萬達電影院線股份有限公司—A股	-	6,200	-	2,800	3,400
萬華化學集團股份有限公司—A股	-	14,300	-	6,600	7,700
萬向錢潮股份有限公司—A股	-	15,600	-	7,200	8,400
濰柴動力股份有限公司—A股	-	20,800	-	11,900	8,900
無錫威孚高科技集團股份有限公司—A股	-	7,400	-	4,400	3,000
西部礦業股份有限公司—A股	-	15,600	-	7,200	8,400
西部證券股份有限公司—A股	-	22,200	-	13,400	8,800
成都衛士通信息產業股份有限公司—A股	-	2,600	-	1,200	1,400
永泰能源股份有限公司—A股	-	62,400	-	37,800	24,600
物產中大集團股份有限公司—A股	-	15,300	4,590	11,800	8,090
武漢鋼鐵股份有限公司—A股	-	67,600	-	32,300	35,300
蕪湖順榮三七互娛網絡科技股份有限公司—A股	-	5,200	5,200	5,500	4,900
宜賓五糧液股份有限公司—A股	-	29,300	-	17,200	12,100
徐工集團工程機械股份有限公司—A股	-	48,100	-	26,700	21,400
廈門建發股份有限公司—A股	-	18,450	-	8,400	10,050
廈門國貿集團股份有限公司—A股	-	11,700	-	11,700	-
廈門鑄業股份有限公司—A股	-	7,800	-	4,300	3,500
西安隆基硅材料股份有限公司—A股	-	11,700	-	5,400	6,300
新湖中寶股份有限公司—A股	-	68,900	-	43,700	25,200
新疆金風科技股份有限公司—A股	-	15,600	-	8,800	6,800
新疆中泰化學股份有限公司—A股	-	4,600	-	-	4,600
新興鑄管股份有限公司—A股	-	24,700	-	14,200	10,500
內蒙古西水創業股份有限公司—A股	-	6,700	-	4,300	2,400
許繼電氣股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,000	3,500
陽泉煤業(集團)股份有限公司—A股	-	15,600	-	7,200	8,400
煙台傑瑞石油服務集團股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,900	2,600
億帆醫藥股份有限公司—A股	-	7,900	-	3,600	4,300

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
宜華生活科技股份有限公司—A股	-	10,400	-	4,800	5,600
營口港務股份有限公司—A股	-	36,400	-	21,200	15,200
永輝超市股份有限公司—A股	-	27,300	27,300	25,200	29,400
用友網絡科技股份有限公司—A股	-	10,400	-	5,900	4,500
雅戈爾集團股份有限公司—A股	-	15,600	-	7,200	8,400
遊族網絡股份有限公司—A股	-	3,900	-	1,800	2,100
袁隆平農業高科技股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
雲南白藥集團股份有限公司—A股	-	9,500	-	2,200	7,300
雲南馳宏鋅鎳股份有限公司—A股	-	14,100	13,000	12,100	15,000
雲南錫業股份有限公司—A股	-	3,200	-	-	3,200
漳州片仔癀藥業股份有限公司—A股	-	2,600	1,300	1,800	2,100
浙報傳媒集團股份有限公司—A股	-	7,800	-	3,600	4,200
浙富控股集團股份有限公司—A股	-	13,000	-	13,000	-
浙江中國小商品城集團股份有限公司—A股	-	41,300	-	22,000	19,300
浙江正泰電器股份有限公司—A股	-	9,037	-	4,600	4,437
浙江大華技術股份有限公司—A股	-	7,800	11,700	10,800	8,700
浙江海亮股份有限公司—A股	-	9,100	-	9,100	-
浙江華海藥業股份有限公司—A股	-	6,000	1,800	4,100	3,700
浙江巨化股份有限公司—A股	-	11,608	-	5,400	6,208
浙江龍盛集團股份有限公司—A股	-	22,100	-	12,000	10,100
浙江新和成股份有限公司—A股	-	7,800	-	4,800	3,000
浙江萬豐奧威汽輪股份有限公司—A股	-	6,500	6,500	7,400	5,600
浙江萬馬股份有限公司—A股	-	6,500	-	3,000	3,500
浙江亞廈裝飾股份有限公司—A股	-	9,100	-	5,300	3,800
浙江浙能電力股份有限公司—A股	-	56,700	-	26,400	30,300
鄭州宇通客車股份有限公司—A股	-	15,963	-	8,200	7,763
中弘控股股份有限公司—A股	-	51,700	-	36,300	15,400
中金黃金股份有限公司—A股	-	23,010	-	10,800	12,210
中南紅文化集團股份有限公司—A股	-	5,200	-	2,000	3,200
中山大洋電機股份有限公司—A股	-	11,700	-	5,400	6,300
中天城投集團股份有限公司—A股	-	35,200	-	18,600	16,600
紫金礦業集團股份有限公司—A股	-	106,600	-	57,000	49,600
中聯重科股份有限公司—A股	-	41,600	-	19,200	22,400
中興通訊股份有限公司—A股	-	22,076	-	10,200	11,876

# iShares安碩MSCI中國A股國際指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 人民幣	成分基金交易 資產淨值 人民幣
截至下列日期財務期間結束時 二零一六年十二月三十一日	6.29	66,073,234

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 人民幣	最低每單位 資產淨值 人民幣
截至下列日期止財務期間 二零一六年十二月三十一日(自成立以來)	6.86	5.44

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)	持量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)</b>			
<b>上市股本</b>			
中國農業銀行—A股	119,135,300	412,922,242	1.43
北京銀行股份有限公司—A股	36,432,593	397,563,056	1.38
中國銀行股份有限公司—A股	71,222,301	273,930,609	0.95
交通銀行股份有限公司—A股	79,491,277	512,815,812	1.78
比亞迪股份有限公司—A股	2,046,591	113,678,613	0.39
中信銀行股份有限公司—A股	9,054,588	64,892,252	0.23
中國交通建設股份有限公司—A股	4,692,234	79,689,950	0.28
中國建設銀行股份有限公司—A股	30,459,552	185,262,931	0.64
中國光大銀行股份有限公司—A股	46,985,262	205,401,935	0.71
中國人壽保險股份有限公司—A股	4,923,371	132,606,705	0.46
招商銀行—A股	40,004,221	787,199,131	2.73
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	6,918,781	126,786,980	0.44
中國民生銀行—A股	77,871,014	790,547,189	2.74
中國核能電力股份有限公司—A股	14,484,761	114,335,779	0.40
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	8,509,871	264,219,567	0.92
中國石油化工股份有限公司—A股	32,167,500	194,572,158	0.68
中國鐵建股份有限公司—A股	14,064,821	188,075,190	0.65
中國中鐵股份有限公司—A股	20,691,273	204,968,467	0.71
中國神華能源股份有限公司—A股	6,692,521	121,069,397	0.42
中國船舶重工—A股	29,766,102	235,957,791	0.82
中國建築—A股	40,506,656	401,260,337	1.39
中國長江電力股份有限公司—A股	28,384,970	401,779,955	1.39
中信證券股份有限公司—A股	26,291,724	472,096,440	1.64
中國中車股份有限公司—A股	29,093,908	317,806,478	1.10
大秦鐵路股份有限公司—A股	18,028,515	142,711,619	0.50
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	1,755,082	28,001,900	0.10
廣發證券股份有限公司—A股	10,248,098	193,182,135	0.67
綠地控股集團股份有限公司—A股	7,972,134	77,635,234	0.27
廣州汽車集團股份有限公司—A股	1,457,469	37,756,478	0.13
國信證券股份有限公司—A股	4,115,644	71,554,066	0.25
國泰君安證券股份有限公司—A股	12,510,452	260,027,039	0.90
海通證券股份有限公司—A股	22,390,255	394,280,881	1.37
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	5,989,008	159,433,804	0.55
華泰證券股份有限公司—A股	8,779,186	175,308,036	0.61
中國工商銀行—A股	72,807,041	358,986,478	1.25
興業銀行股份有限公司—A股	54,467,409	982,893,283	3.41
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	1,231,336	97,195,778	0.34
貴州茅台酒股份有限公司—A股	1,552,137	579,879,342	2.01
美的集團股份有限公司—A股	16,064,638	505,969,002	1.76
新華人壽保險股份有限公司—A股	1,909,074	93,446,844	0.32

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
<b>上市股本(續)</b>			
中國石油天然氣股份有限公司—A股	13,608,059	120,956,562	0.42
平安銀行股份有限公司—A股	26,947,712	274,175,983	0.95
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	32,530,686	1,288,636,696	4.47
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	19,926,708	203,410,073	0.71
上海汽車集團股份有限公司—A股	7,772,837	203,792,655	0.71
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	12,913,773	73,924,642	0.26
上海浦東發展銀行—A股	35,800,140	648,834,389	2.25
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	2,599,753	67,115,394	0.23
申萬宏源集團股份有限公司—A股	18,904,149	132,100,137	0.46
宜實五糧液股份有限公司—A股	5,897,724	227,361,969	0.79
總上市股本		14,398,009,383	49.97

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
<b>由Citigroup Global Markets Holdings Inc.發行的上市 CAAP，持有下列公司股份</b>			
中國農業銀行—A股	10,091,244	34,976,186	0.12
北京銀行股份有限公司—A股	3,089,940	33,718,317	0.12
中國銀行股份有限公司—A股	6,026,119	23,177,287	0.08
交通銀行股份有限公司—A股	5,724,043	36,927,081	0.13
比亞迪股份有限公司—A股	159,000	8,831,710	0.03
中信銀行股份有限公司—A股	763,226	5,469,876	0.02
中國交通建設股份有限公司—A股	397,480	6,750,549	0.02
中國建設銀行股份有限公司—A股	2,575,789	15,666,626	0.05
中國光大銀行股份有限公司—A股	3,974,972	17,377,078	0.06
中國人壽保險股份有限公司—A股	422,238	11,372,613	0.04
招商銀行—A股	3,381,374	66,538,349	0.23
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	596,800	10,936,388	0.04
中國民生銀行—A股	6,587,943	66,880,842	0.23
中國核能電力股份有限公司—A股	1,107,700	8,743,654	0.03
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	720,750	22,378,274	0.08
中國石油化工股份有限公司—A股	2,718,870	16,445,679	0.06
中國鐵建股份有限公司—A股	1,075,926	14,387,311	0.05
中國中鐵股份有限公司—A股	1,589,951	15,750,107	0.05
中國神華能源股份有限公司—A股	570,292	10,316,725	0.04
中國船舶重工—A股	2,517,478	19,956,215	0.07
中國建築—A股	3,434,400	34,021,280	0.12
中信證券股份有限公司—A股	2,220,692	39,874,937	0.14
中國中車股份有限公司—A股	2,231,251	24,373,010	0.08
大秦鐵路股份有限公司—A股	1,543,112	12,215,093	0.04
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	153,700	2,452,245	0.01
廣發證券股份有限公司—A股	671,043	12,649,517	0.04
綠地控股集團股份有限公司—A股	391,900	3,816,450	0.01
廣州汽車集團股份有限公司—A股	100,700	2,608,685	0.01
國信證券股份有限公司—A股	344,486	5,989,190	0.02
國泰君安證券股份有限公司—A股	954,000	19,828,685	0.07
海通證券股份有限公司—A股	1,717,235	30,239,626	0.10
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	459,018	12,219,548	0.04
華泰證券股份有限公司—A股	747,332	14,923,172	0.05
中國工商銀行—A股	6,169,186	30,418,110	0.11
興業銀行股份有限公司—A股	3,921,954	70,773,732	0.25
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	106,000	8,367,133	0.03
貴州茅台酒股份有限公司—A股	127,238	47,536,193	0.17
美的集團股份有限公司—A股	766,093	24,128,728	0.08

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
<b>由Citigroup Global Markets Holdings Inc.發行的上市 CAAP，持有下列公司股份(續)</b>			
新華人壽保險股份有限公司－A股	158,991	7,782,415	0.03
中國石油天然氣股份有限公司－A股	1,174,213	10,437,111	0.04
平安銀行股份有限公司－A股	2,061,653	20,976,015	0.07
中國平安保險(集團)股份有限公司－A股	2,634,101	104,344,526	0.36
保利房地產(集團)股份有限公司－A股	1,685,400	17,204,415	0.06
上海汽車集團股份有限公司－A股	662,533	17,370,667	0.06
上海國際港務(集團)股份有限公司－A股	898,873	5,145,579	0.02
上海浦東發展銀行－A股	3,026,310	54,848,220	0.19
上海萊士血液製品股份有限公司－A股	222,600	5,746,656	0.02
申萬宏源集團股份有限公司－A股	1,633,190	11,412,556	0.04
宜賓五糧液股份有限公司－A股	498,200	19,206,006	0.07
		<hr/>	
		1,117,510,367	3.88

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
<b>由Credit Suisse AG, Nassau Branch發行的上市 CAAP，持有下列公司股份</b>			
中國農業銀行—A股	10,471,968	36,295,773	0.13
北京銀行股份有限公司—A股	3,206,520	34,990,472	0.12
中國銀行股份有限公司—A股	6,253,470	24,051,711	0.08
交通銀行股份有限公司—A股	5,940,043	38,320,546	0.13
比亞迪股份有限公司—A股	165,000	9,164,982	0.03
中信銀行股份有限公司—A股	791,955	5,675,771	0.02
中國交通建設股份有限公司—A股	412,528	7,006,115	0.03
中國建設銀行股份有限公司—A股	2,672,991	16,257,834	0.06
中國光大銀行股份有限公司—A股	4,125,040	18,033,119	0.06
中國人壽保險股份有限公司—A股	439,711	11,843,233	0.04
招商銀行—A股	3,509,035	69,050,449	0.24
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	620,900	11,378,022	0.04
中國民生銀行—A股	6,836,499	69,404,184	0.24
中國核能電力股份有限公司—A股	1,149,500	9,073,603	0.03
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	747,969	23,223,386	0.08
中國石油化工股份有限公司—A股	2,821,496	17,066,434	0.06
中國鐵建股份有限公司—A股	1,116,525	14,930,202	0.05
中國中鐵股份有限公司—A股	1,650,035	16,345,301	0.06
中國神華能源股份有限公司—A股	593,357	10,733,976	0.04
中國船舶重工—A股	2,612,485	20,709,342	0.07
中國建築—A股	3,564,015	35,305,250	0.12
中信證券股份有限公司—A股	2,304,524	41,380,232	0.14
中國中車股份有限公司—A股	2,315,492	25,293,214	0.09
大秦鐵路股份有限公司—A股	1,604,536	12,701,318	0.04
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	159,500	2,544,783	0.01
廣發證券股份有限公司—A股	697,908	13,155,937	0.05
綠地控股集團股份有限公司—A股	406,700	3,960,577	0.01
廣州汽車集團股份有限公司—A股	104,500	2,707,126	0.01
國信證券股份有限公司—A股	357,546	6,216,249	0.02
國泰君安證券股份有限公司—A股	990,000	20,576,937	0.07
海通證券股份有限公司—A股	1,781,968	31,379,541	0.11
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	477,915	12,722,607	0.04
華泰證券股份有限公司—A股	775,453	15,484,709	0.05
中國工商銀行—A股	6,402,001	31,566,040	0.11
興業銀行股份有限公司—A股	4,070,039	73,446,004	0.26
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	110,000	8,682,874	0.03
貴州茅台酒股份有限公司—A股	131,965	49,302,203	0.17
美的集團股份有限公司—A股	796,570	25,088,626	0.09
新華人壽保險股份有限公司—A股	165,017	8,077,380	0.03

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
<b>由Credit Suisse AG, Nassau Branch發行的上市 CAAP，持有下列公司股份(續)</b>			
中國石油天然氣股份有限公司－A股	1,220,118	10,845,142	0.04
平安銀行股份有限公司－A股	2,139,453	21,767,581	0.08
中國平安保險(集團)股份有限公司－A股	2,733,527	108,283,084	0.38
保利房地產(集團)股份有限公司－A股	1,749,000	17,853,638	0.06
上海汽車集團股份有限公司－A股	687,507	18,025,449	0.06
上海國際港務(集團)股份有限公司－A股	934,355	5,348,695	0.02
上海浦東發展銀行－A股	3,140,543	56,918,555	0.20
上海萊士血液製品股份有限公司－A股	231,000	5,963,511	0.02
申萬宏源集團股份有限公司－A股	1,697,970	11,865,231	0.04
宜賓五糧液股份有限公司－A股	517,000	19,930,761	0.07
		<hr/>	
		1,159,947,709	4.03

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
<b>由HSBC Bank plc發行的上市CAAP，持有下列公司股份</b>			
中國農業銀行—A股	20,943,974	72,591,678	0.25
北京銀行股份有限公司—A股	6,412,980	69,980,289	0.24
中國銀行股份有限公司—A股	12,507,047	48,103,833	0.17
比亞迪股份有限公司—A股	328,800	18,263,310	0.06
中信銀行股份有限公司—A股	1,584,004	11,352,215	0.04
中國交通建設股份有限公司—A股	824,988	14,011,074	0.05
中國建設銀行股份有限公司—A股	5,345,982	32,515,668	0.11
中國光大銀行股份有限公司—A股	8,249,965	36,065,736	0.13
中國人壽保險股份有限公司—A股	876,888	23,618,215	0.08
招商銀行—A股	7,017,954	138,098,616	0.48
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	1,239,200	22,708,398	0.08
中國民生銀行—A股	13,672,997	138,808,358	0.48
中國核能電力股份有限公司—A股	2,299,000	18,147,206	0.06
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	1,496,027	46,449,535	0.16
中國石油化工股份有限公司—A股	5,642,994	34,132,881	0.12
中國鐵建股份有限公司—A股	2,233,007	29,859,829	0.10
中國中鐵股份有限公司—A股	3,299,990	32,689,810	0.11
中國神華能源股份有限公司—A股	1,182,988	21,400,548	0.07
中國船舶重工—A股	5,224,958	41,418,589	0.14
中國建築—A股	7,127,999	70,610,193	0.25
中信證券股份有限公司—A股	4,609,031	82,760,158	0.29
中國中車股份有限公司—A股	4,630,981	50,586,395	0.18
大秦鐵路股份有限公司—A股	3,201,275	25,340,916	0.09
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	319,000	5,089,566	0.02
廣發證券股份有限公司—A股	1,392,047	26,240,826	0.09
綠地控股集團股份有限公司—A股	812,100	7,908,494	0.03
廣州汽車集團股份有限公司—A股	209,000	5,414,252	0.02
國信證券股份有限公司—A股	715,007	12,431,021	0.04
國泰君安證券股份有限公司—A股	1,980,000	41,153,874	0.14
海通證券股份有限公司—A股	3,564,012	62,760,420	0.22
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	953,151	25,373,896	0.09
華泰證券股份有限公司—A股	1,551,022	30,971,734	0.11
中國工商銀行—A股	12,804,028	63,132,207	0.22
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	220,000	17,365,748	0.06
貴州茅台酒股份有限公司—A股	264,027	98,640,646	0.34
美的集團股份有限公司—A股	1,589,340	50,057,568	0.17
新華人壽保險股份有限公司—A股	329,998	16,152,998	0.06
中國石油天然氣股份有限公司—A股	2,435,145	21,645,032	0.08
平安銀行股份有限公司—A股	4,279,018	43,536,301	0.15

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
由HSBC Bank plc發行的上市CAAP，持有下列公司股份(續)			
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	4,011,827	158,920,325	0.55
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	3,498,000	35,707,276	0.12
上海汽車集團股份有限公司—A股	1,375,023	36,051,135	0.12
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	1,865,001	10,676,158	0.04
上海浦東發展銀行—A股	6,281,009	113,835,715	0.40
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	462,000	11,927,021	0.04
申萬宏源集團股份有限公司—A股	3,388,330	23,677,285	0.08
宜賓五糧液股份有限公司—A股	1,034,000	39,861,522	0.14
		<hr/>	
		2,038,044,470	7.07

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
由J.P. Morgan Structured Products B.V. 發行並由JP Morgan Chase Bank, N.A. 提供擔保的上市CAAP，持有下列公司股份			
中國農業銀行－A股	56,167,996	194,677,910	0.68
北京銀行股份有限公司－A股	17,198,540	187,675,433	0.65
中國銀行股份有限公司－A股	33,541,475	129,005,153	0.45
交通銀行股份有限公司－A股	31,860,046	205,536,282	0.71
比亞迪股份有限公司－A股	878,000	48,768,814	0.17
中信銀行股份有限公司－A股	4,248,000	30,444,500	0.11
中國交通建設股份有限公司－A股	2,212,526	37,576,142	0.13
中國建設銀行股份有限公司－A股	14,337,045	87,201,678	0.30
中國光大銀行股份有限公司－A股	22,125,049	96,722,370	0.34
中國人壽保險股份有限公司－A股	2,341,410	63,063,840	0.22
招商銀行－A股	18,820,957	370,356,961	1.29
招商局蛇口工業區控股股份有限公司－A股	3,305,700	60,577,108	0.21
中國民生銀行－A股	36,668,492	372,258,780	1.29
中國核能電力股份有限公司－A股	6,165,500	48,667,508	0.17
中國太平洋保險(集團)股份有限公司－A股	4,012,000	124,566,960	0.43
中國石油化工股份有限公司－A股	15,133,513	91,538,356	0.32
中國鐵建股份有限公司－A股	5,988,467	80,077,940	0.28
中國中鐵股份有限公司－A股	8,849,973	87,668,125	0.30
中國神華能源股份有限公司－A股	3,159,236	57,151,367	0.20
中國船舶重工－A股	14,012,517	111,078,152	0.39
中國建築－A股	19,116,008	189,363,806	0.66
中信證券股份有限公司－A股	12,360,534	221,946,814	0.77
中國中車股份有限公司－A股	12,419,530	135,664,399	0.47
大秦鐵路股份有限公司－A股	8,542,570	67,621,978	0.23
分眾傳媒信息技術股份有限公司－A股	849,700	13,556,752	0.05
廣發證券股份有限公司－A股	3,715,921	70,047,086	0.24
綠地控股集團股份有限公司－A股	2,165,600	21,089,317	0.07
廣州汽車集團股份有限公司－A股	556,700	14,421,599	0.05
國信證券股份有限公司－A股	1,917,488	33,337,203	0.12
國泰君安證券股份有限公司－A股	5,310,000	110,367,207	0.38
海通證券股份有限公司－A股	9,557,965	168,310,852	0.58
杭州海康威視數字技術股份有限公司－A股	2,543,880	67,720,798	0.23
華泰證券股份有限公司－A股	4,159,495	83,059,282	0.29
中國工商銀行－A股	34,337,954	169,308,504	0.59
興業銀行股份有限公司－A股	21,829,996	393,933,813	1.37
江蘇洋河酒廠股份有限公司－A股	586,001	46,256,116	0.16
貴州茅台酒股份有限公司－A股	707,998	264,508,479	0.92
美的集團股份有限公司－A股	4,240,741	133,565,618	0.46

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
由J.P. Morgan Structured Products B.V. 發行並由JP Morgan Chase Bank, N.A. 提供擔保的上市CAAP，持有下列公司股份(續)			
新華人壽保險股份有限公司－A股	884,966	43,318,002	0.15
中國石油天然氣股份有限公司－A股	6,496,809	57,747,542	0.20
平安銀行股份有限公司－A股	11,475,491	116,755,861	0.40
中國平安保險(集團)股份有限公司－A股	14,661,483	580,784,675	2.02
保利房地產(集團)股份有限公司－A股	9,381,000	95,760,423	0.33
上海汽車集團股份有限公司－A股	3,687,535	96,681,889	0.33
上海國際港務(集團)股份有限公司－A股	4,975,806	28,483,895	0.10
上海浦東發展銀行－A股	16,844,512	305,286,469	1.06
上海萊士血液製品股份有限公司－A股	1,239,000	31,986,102	0.11
申萬宏源集團股份有限公司－A股	9,040,665	63,175,193	0.22
宜賓五糧液股份有限公司－A股	2,773,000	106,901,354	0.37
		<hr/>	
		6,215,574,407	21.57

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
<b>由Macquarie Bank Ltd發行的上市CAAP，持有下列公司股份</b>			
中國農業銀行—A股	23,990,352	83,150,405	0.29
北京銀行股份有限公司—A股	7,345,800	80,159,490	0.28
中國銀行股份有限公司—A股	14,326,231	55,100,666	0.19
交通銀行股份有限公司—A股	13,608,001	87,788,258	0.31
比亞迪股份有限公司—A股	375,000	20,829,505	0.07
中信銀行股份有限公司—A股	1,814,400	13,003,414	0.05
中國交通建設股份有限公司—A股	945,002	16,049,316	0.06
中國建設銀行股份有限公司—A股	6,123,559	37,245,096	0.13
中國光大銀行股份有限公司—A股	9,449,988	41,311,784	0.14
中國人壽保險股份有限公司—A股	999,320	26,915,814	0.09
招商銀行—A股	8,038,849	158,187,689	0.55
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	1,411,100	25,858,474	0.09
中國民生銀行—A股	15,661,822	158,998,923	0.55
中國核能電力股份有限公司—A股	2,633,400	20,786,800	0.07
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	1,713,643	53,206,206	0.19
中國石油化工股份有限公司—A股	6,463,807	39,097,747	0.14
中國鐵建股份有限公司—A股	2,557,756	34,202,381	0.12
中國中鐵股份有限公司—A股	3,779,970	37,444,508	0.13
中國神華能源股份有限公司—A股	1,348,550	24,395,606	0.09
中國船舶重工—A股	5,985,047	47,443,865	0.17
中國建築—A股	8,164,771	80,880,491	0.28
中信證券股份有限公司—A股	5,279,411	94,797,559	0.33
中國中車股份有限公司—A股	5,304,621	57,944,883	0.20
大秦鐵路股份有限公司—A股	3,646,523	28,865,446	0.10
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	362,500	5,783,597	0.02
廣發證券股份有限公司—A股	1,586,091	29,898,658	0.10
綠地控股集團股份有限公司—A股	924,300	9,001,134	0.03
廣州汽車集團股份有限公司—A股	237,500	6,152,559	0.02
國信證券股份有限公司—A股	819,039	14,239,708	0.05
國泰君安證券股份有限公司—A股	2,268,000	47,139,892	0.16
海通證券股份有限公司—A股	4,082,424	71,889,389	0.25
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	1,086,110	28,913,406	0.10
華泰證券股份有限公司—A股	1,776,570	35,475,611	0.12
中國工商銀行—A股	14,666,370	72,314,768	0.25
興業銀行股份有限公司—A股	9,323,951	168,255,623	0.58
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	250,000	19,733,804	0.07
貴州茅台酒股份有限公司—A股	302,404	112,978,317	0.39
美的集團股份有限公司—A股	1,810,363	57,018,869	0.20
新華人壽保險股份有限公司—A股	377,954	18,500,385	0.06

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
由Macquarie Bank Ltd發行的上市CAAP，持有下列 公司股份(續)			
中國石油天然氣股份有限公司－A股	2,772,901	24,647,210	0.09
平安銀行股份有限公司－A股	4,901,390	49,868,542	0.17
中國平安保險(集團)股份有限公司－A股	6,262,221	248,065,083	0.86
保利房地產(集團)股份有限公司－A股	4,006,800	40,901,062	0.14
上海汽車集團股份有限公司－A股	1,574,997	41,294,167	0.14
上海國際港務(集團)股份有限公司－A股	2,123,586	12,156,423	0.04
上海浦東發展銀行－A股	7,194,633	130,394,048	0.45
上海萊士血液製品股份有限公司－A股	529,200	13,661,861	0.05
申萬宏源集團股份有限公司－A股	3,859,000	26,966,276	0.09
宜賓五糧液股份有限公司－A股	1,184,400	45,659,561	0.16
		<hr/>	
		2,654,574,279	9.21

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.71%)(續)</b>			
<b>由UBS AG London Branch發行的上市CAAP，持有 下列公司股份</b>			
中國農業銀行－A股	12,566,389	43,555,023	0.15
北京銀行股份有限公司－A股	3,847,800	41,988,304	0.15
中國銀行股份有限公司－A股	7,504,186	28,862,138	0.10
交通銀行股份有限公司－A股	7,127,952	45,984,012	0.16
中信銀行股份有限公司－A股	950,437	6,811,577	0.02
中國交通建設股份有限公司－A股	495,022	8,407,141	0.03
中國建設銀行股份有限公司－A股	3,207,588	19,509,394	0.07
中國光大銀行股份有限公司－A股	4,950,001	21,639,538	0.08
中國人壽保險股份有限公司－A股	524,721	14,132,903	0.05
招商銀行－A股	4,210,837	82,860,441	0.29
招商局蛇口工業區控股股份有限公司－A股	739,200	13,545,875	0.05
中國民生銀行－A股	8,203,831	83,285,348	0.29
中國太平洋保險(集團)股份有限公司－A股	897,584	27,868,721	0.10
中國石油化工股份有限公司－A股	3,385,774	20,479,593	0.07
中國神華能源股份有限公司－A股	706,178	12,774,936	0.04
中國船舶重工－A股	3,134,992	24,851,290	0.09
中國建築－A股	4,276,803	42,366,152	0.15
中信證券股份有限公司－A股	2,765,360	49,655,043	0.17
大秦鐵路股份有限公司－A股	1,910,710	15,124,955	0.05
分眾傳媒信息技術股份有限公司－A股	191,400	3,053,739	0.01
綠地控股集團股份有限公司－A股	485,100	4,724,061	0.02
廣州汽車集團股份有限公司－A股	125,400	3,248,551	0.01
國信證券股份有限公司－A股	428,953	7,457,722	0.03
華泰證券股份有限公司－A股	930,608	18,582,937	0.06
中國工商銀行－A股	7,682,436	37,879,419	0.13
興業銀行股份有限公司－A股	4,883,957	88,133,585	0.31
江蘇洋河酒廠股份有限公司－A股	132,000	10,419,449	0.04
貴州茅台酒股份有限公司－A股	158,433	59,190,664	0.21
新華人壽保險股份有限公司－A股	197,969	9,690,340	0.03
中國石油天然氣股份有限公司－A股	1,455,259	12,935,216	0.04
中國平安保險(集團)股份有限公司－A股	3,280,155	129,936,634	0.45
保利房地產(集團)股份有限公司－A股	2,098,800	21,424,366	0.07
上海汽車集團股份有限公司－A股	824,997	21,630,240	0.07
上海浦東發展銀行－A股	3,768,595	68,301,240	0.24
上海萊士血液製品股份有限公司－A股	277,200	7,156,213	0.02
申萬宏源集團股份有限公司－A股	2,022,875	14,135,633	0.05
宜賓五糧液股份有限公司－A股	620,400	23,916,913	0.08
		1,145,519,306	3.98

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	公平價值 港元	資產淨值 百分比
中國(99.71%)(續)		
由UBS AG London Branch發行的上市CAAP，持有 下列公司股份(續)		
CAAP總額	14,331,170,538	49.74
投資總額	28,729,179,921	99.71
其他資產淨值	84,199,272	0.29
於二零一六年十二月三十一日基金單位持有人 應佔資產淨值	28,813,379,193	100.00
投資總額(按成本)	27,203,493,400	

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
中國農業銀行—A股	77,328,900	67,108,200	-	25,301,800	119,135,300
北京銀行股份有限公司—A股	-	38,607,475	5,445,918	7,620,800	36,432,593
中國銀行股份有限公司—A股	28,232,601	58,006,500	-	15,016,800	71,222,301
交通銀行股份有限公司—A股	51,879,929	45,492,348	-	17,881,000	79,491,277
比亞迪股份有限公司—A股	1,181,384	1,526,307	-	661,100	2,046,591
中信銀行股份有限公司—A股	9,844,286	4,384,702	-	5,174,400	9,054,588
中國交通建設股份有限公司—A股	1,944,900	3,951,734	-	1,204,400	4,692,234
中國建設銀行股份有限公司—A股	23,273,733	14,769,800	-	7,583,981	30,459,552
中國光大銀行股份有限公司—A股	19,239,300	37,789,162	-	10,043,200	46,985,262
中國人壽保險股份有限公司—A股	4,511,775	2,316,496	-	1,904,900	4,923,371
招商銀行—A股	35,787,628	19,339,593	-	15,123,000	40,004,221
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	-	8,401,381	-	1,482,600	6,918,781
中國民生銀行—A股	62,914,009	45,519,505	-	30,562,500	77,871,014
中國核能電力股份有限公司—A股	11,435,461	7,805,100	-	4,755,800	14,484,761
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	5,423,614	5,597,757	-	2,511,500	8,509,871
中國石油化工股份有限公司—A股	13,916,600	25,141,000	-	6,890,100	32,167,500
中國鐵建股份有限公司—A股	8,050,758	9,856,563	-	3,842,500	14,064,821
中國中鐵股份有限公司—A股	21,596,335	10,793,038	-	11,698,100	20,691,273
中國神華能源股份有限公司—A股	5,782,086	3,220,935	-	2,310,500	6,692,521
中國船舶重工—A股	17,983,020	17,420,382	-	5,637,300	29,766,102
中國建築—A股	38,207,420	19,611,536	-	17,312,300	40,506,656
中國聯合網絡—A股	24,825,854	3,396,800	-	28,222,654	-
萬科企業股份有限公司—A股	26,814,750	-	-	26,814,750	-
中國長江電力股份有限公司—A股	-	28,384,970	-	-	28,384,970
中信證券股份有限公司—A股	24,003,010	12,694,914	-	10,406,200	26,291,724
中國中車股份有限公司—A股	16,104,449	18,597,259	-	5,607,800	29,093,908
大秦鐵路股份有限公司—A股	17,517,877	8,348,638	-	7,838,000	18,028,515
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	-	1,493,082	577,000	315,000	1,755,082
廣發證券股份有限公司—A股	6,031,731	6,131,067	-	1,914,700	10,248,098
珠海格力電器股份有限公司—A股	810,400	2,232,909	-	3,043,309	-
綠地控股集團股份有限公司—A股	-	8,722,134	-	750,000	7,972,134
廣州汽車集團股份有限公司—A股	-	1,647,469	-	190,000	1,457,469
國信證券股份有限公司—A股	3,190,815	2,027,729	-	1,102,900	4,115,644
國泰君安證券股份有限公司—A股	4,515,758	10,851,694	-	2,857,000	12,510,452
海通證券股份有限公司—A股	14,935,494	11,983,061	-	4,528,300	22,390,255
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	3,009,331	2,946,296	1,483,881	1,450,500	5,989,008
華能國際電力股份有限公司—A股	5,121,781	2,417,589	-	7,539,370	-
華泰證券股份有限公司—A股	5,175,769	5,412,617	-	1,809,200	8,779,186
中國工商銀行—A股	48,457,641	41,713,900	-	17,364,500	72,807,041
興業銀行股份有限公司—A股	38,530,052	28,293,257	-	12,355,900	54,467,409
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司—A股	20,913,500	5,192,500	-	26,106,000	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	-	1,431,336	-	200,000	1,231,336
貴州茅台酒股份有限公司—A股	1,422,300	740,337	-	610,500	1,552,137
美的集團股份有限公司—A股	4,605,983	10,943,164	2,465,591	1,950,100	16,064,638
新華人壽保險股份有限公司—A股	1,318,828	999,946	-	409,700	1,909,074
中國石油天然氣股份有限公司—A股	9,496,181	6,999,178	-	2,887,300	13,608,059
平安銀行股份有限公司—A股	13,107,293	15,584,879	3,411,440	5,155,900	26,947,712
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	24,843,980	24,198,383	-	16,511,677	32,530,686
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	-	23,495,008	-	3,568,300	19,926,708
中國電力建設集團有限公司—A股	8,184,889	1,257,600	-	9,442,489	-
上海汽車集團股份有限公司—A股	6,827,193	3,783,444	-	2,837,800	7,772,837
上海電氣集團總公司—A股	4,230,584	1,813,012	-	6,043,596	-
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	4,686,409	10,211,264	-	1,983,900	12,913,773
上海浦東發展銀行—A股	25,709,184	18,840,371	2,745,985	11,495,400	35,800,140
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	1,196,228	1,120,843	1,061,382	778,700	2,599,753
申萬宏源集團股份有限公司—A股	8,949,554	9,578,704	4,156,691	3,780,800	18,904,149
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	9,617,433	1,385,685	-	11,003,118	-
宜賓五糧液股份有限公司—A股	-	6,985,524	-	1,087,800	5,897,724
浙江浙能電力股份有限公司—A股	6,823,422	915,200	-	7,738,622	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由BARCLAYS BANK PLC發行的上市CAAP</b>					
中國農業銀行—A股	6,705,238	5,395,900	-	12,101,138	-
北京銀行股份有限公司—A股	-	1,831,600	-	1,831,600	-
中國銀行股份有限公司—A股	27,438,656	-	-	27,438,656	-
交通銀行股份有限公司—A股	5,144,175	1,053,200	-	6,197,375	-
比亞迪股份有限公司—A股	145,000	6,300	-	151,300	-
中信銀行股份有限公司—A股	-	627,000	-	627,000	-
中國交通建設股份有限公司—A股	511,142	-	-	511,142	-
中國建設銀行股份有限公司—A股	3,248,130	-	-	3,248,130	-
中國光大銀行股份有限公司—A股	1,155,500	3,936,600	-	5,092,100	-
中國人壽保險股份有限公司—A股	347,215	154,200	-	501,415	-
招商銀行—A股	4,850,827	-	-	4,850,827	-
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	-	418,000	-	418,000	-
中國民生銀行—A股	8,036,819	-	-	8,036,819	-
中國核能電力股份有限公司—A股	1,384,400	-	-	1,384,400	-
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	-	513,000	-	513,000	-
中國石油化工股份有限公司—A股	11,066,829	-	-	11,066,829	-
中國鐵建股份有限公司—A股	1,038,107	-	-	1,038,107	-
中國中鐵股份有限公司—A股	902,656	1,009,800	-	1,912,456	-
中國神華能源股份有限公司—A股	744,449	-	-	744,449	-
中國船舶重工—A股	3,319,363	-	-	3,319,363	-
中國建築—A股	597,100	2,443,400	-	3,040,500	-
中國聯合網絡—A股	3,196,403	-	-	3,196,403	-
萬科企業股份有限公司—A股	3,018,320	-	-	3,018,320	-
中信證券股份有限公司—A股	2,029,298	634,100	-	2,663,398	-
中國中車股份有限公司—A股	2,909,572	-	-	2,909,572	-
大秦鐵路股份有限公司—A股	4,375,913	-	-	4,375,913	-
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	-	41,800	-	41,800	-
廣發證券股份有限公司—A股	2,217,657	-	-	2,217,657	-
珠海格力電器股份有限公司—A股	682,967	-	-	682,967	-
國信證券股份有限公司—A股	464,412	-	-	464,412	-
國泰君安證券股份有限公司—A股	540,600	-	-	540,600	-
海通證券股份有限公司—A股	2,253,867	-	-	2,253,867	-
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	304,243	59,900	-	364,143	-
華能國際電力股份有限公司—A股	156,700	383,800	-	540,500	-
華泰證券股份有限公司—A股	1,701,522	-	-	1,701,522	-
中國工商銀行—A股	9,124,827	-	-	9,124,827	-
興業銀行股份有限公司—A股	3,769,253	622,600	-	4,391,853	-
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司—A股	3,032,400	-	-	3,032,400	-
貴州茅台酒股份有限公司—A股	34,061	91,200	-	125,261	-
美的集團股份有限公司—A股	655,669	-	122,184	777,853	-
新華人壽保險股份有限公司—A股	211,701	-	-	211,701	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由BARCLAYS BANK PLC發行的上市CAAP(續)</b>					
中國石油天然氣股份有限公司-A股	335,000	890,300	-	1,225,300	-
平安銀行股份有限公司-A股	2,253,870	-	-	2,253,870	-
中國平安保險(集團)股份有限公司-A股	3,619,846	-	-	3,619,846	-
中國電力建設集團有限公司-A股	1,176,800	-	-	1,176,800	-
上海汽車集團股份有限公司-A股	826,003	33,200	-	859,203	-
上海電氣集團總公司-A股	633,100	158,900	-	792,000	-
上海國際港務(集團)股份有限公司-A股	1,228,132	-	-	1,228,132	-
上海浦東發展銀行-A股	3,222,378	169,200	-	3,391,578	-
上海萊士血液製品股份有限公司-A股	158,200	-	-	158,200	-
申萬宏源集團股份有限公司-A股	1,209,000	97,200	-	1,306,200	-
蘇寧雲商集團股份有限公司-A股	1,420,639	-	-	1,420,639	-
浙江浙能電力股份有限公司-A股	954,000	-	-	954,000	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由 CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS INC. 發行的上市 CAAP</b>					
中國農業銀行—A股	16,737,144	5,549,700	-	12,195,600	10,091,244
北京銀行股份有限公司—A股	-	5,449,200	1,089,840	3,449,100	3,089,940
中國銀行股份有限公司—A股	14,232,319	1,466,400	-	9,672,600	6,026,119
交通銀行股份有限公司—A股	27,007,043	3,076,900	-	24,359,900	5,724,043
比亞迪股份有限公司—A股	248,600	87,500	-	177,100	159,000
中信銀行股份有限公司—A股	1,164,026	691,900	-	1,092,700	763,226
中國交通建設股份有限公司—A股	362,680	541,400	-	506,600	397,480
中國建設銀行股份有限公司—A股	5,784,189	619,100	-	3,827,500	2,575,789
中國光大銀行股份有限公司—A股	6,943,172	1,836,700	-	4,804,900	3,974,972
中國人壽保險股份有限公司—A股	738,438	188,700	-	504,900	422,238
招商銀行—A股	5,826,674	1,648,000	-	4,093,300	3,381,374
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	-	1,242,600	-	645,800	596,800
中國民生銀行—A股	12,550,943	3,081,900	-	9,044,900	6,587,943
中國核能電力股份有限公司—A股	2,373,100	268,000	-	1,533,400	1,107,700
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	1,348,850	242,400	-	870,500	720,750
中國石油化工股份有限公司—A股	6,257,270	661,600	-	4,200,000	2,718,870
中國鐵建股份有限公司—A股	1,421,526	706,600	-	1,052,200	1,075,926
中國中鐵股份有限公司—A股	2,327,651	1,197,900	-	1,935,600	1,589,951
中國神華能源股份有限公司—A股	571,992	687,000	-	688,700	570,292
中國船舶重工—A股	7,612,778	589,200	-	5,684,500	2,517,478
中國建築—A股	7,430,400	832,100	-	4,828,100	3,434,400
中國聯合網絡—A股	4,868,104	568,800	-	5,436,904	-
萬科企業股份有限公司—A股	3,154,563	550,800	-	3,705,363	-
中信證券股份有限公司—A股	1,644,392	3,266,200	-	2,689,900	2,220,692
中國中車股份有限公司—A股	4,992,751	538,700	-	3,300,200	2,231,251
大秦鐵路股份有限公司—A股	437,112	2,939,400	-	1,833,400	1,543,112
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	-	163,300	125,400	135,000	153,700
廣發證券股份有限公司—A股	1,418,843	161,100	-	908,900	671,043
珠海格力電器股份有限公司—A股	1,512,524	120,000	-	1,632,524	-
綠地控股集團股份有限公司—A股	-	525,400	-	133,500	391,900
廣州汽車集團股份有限公司—A股	-	205,200	-	104,500	100,700
國信證券股份有限公司—A股	626,586	141,800	-	423,900	344,486
國泰君安證券股份有限公司—A股	926,700	802,800	-	775,500	954,000
海通證券股份有限公司—A股	1,929,035	1,871,200	-	2,083,000	1,717,235
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	513,446	153,300	320,572	528,300	459,018
華能國際電力股份有限公司—A股	575,075	615,300	-	1,190,375	-
華泰證券股份有限公司—A股	1,401,532	354,700	-	1,008,900	747,332
中國工商銀行—A股	14,000,786	1,491,500	-	9,323,100	6,169,186
興業銀行股份有限公司—A股	17,090,254	1,866,800	-	15,035,100	3,921,954
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司—A股	4,472,000	645,000	-	5,117,000	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由 CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS</b>					
<b>INC. 發行的上市 CAAP (續)</b>					
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	-	199,600	-	93,600	106,000
貴州茅台酒股份有限公司—A股	94,338	191,900	-	159,000	127,238
美的集團股份有限公司—A股	853,629	253,800	528,664	870,000	766,093
新華人壽保險股份有限公司—A股	347,591	42,200	-	230,800	158,991
中國石油天然氣股份有限公司—A股	2,574,513	279,000	-	1,679,300	1,174,213
平安銀行股份有限公司—A股	4,753,078	402,000	724,375	3,817,800	2,061,653
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	7,597,001	1,648,300	-	6,611,200	2,634,101
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	-	2,321,700	-	636,300	1,685,400
中國電力建設集團有限公司—A股	1,724,700	252,800	-	1,977,500	-
上海汽車集團股份有限公司—A股	1,478,033	162,300	-	977,800	662,533
上海電氣集團總公司—A股	2,933,553	144,000	-	3,077,553	-
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	2,920,273	213,400	-	2,234,800	898,873
上海浦東發展銀行—A股	3,776,773	2,438,200	582,537	3,771,200	3,026,310
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	226,600	49,900	142,000	195,900	222,600
申萬宏源集團股份有限公司—A股	1,792,400	727,000	881,790	1,768,000	1,633,190
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	2,208,850	252,000	-	2,460,850	-
宜賓五糧液股份有限公司—A股	-	1,060,200	-	562,000	498,200
浙江浙能電力股份有限公司—A股	1,348,700	267,200	-	1,615,900	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由 CREDIT SUISSE AG, NASSAU BRANCH 發行的 上市 CAAP					
中國農業銀行—A股	41,265,468	2,294,600	-	33,088,100	10,471,968
北京銀行股份有限公司—A股	-	5,690,500	591,920	3,075,900	3,206,520
中國銀行股份有限公司—A股	35,585,570	-	-	29,332,100	6,253,470
交通銀行股份有限公司—A股	22,556,643	1,065,500	-	17,682,100	5,940,043
比亞迪股份有限公司—A股	477,400	85,200	-	397,600	165,000
中信銀行股份有限公司—A股	3,469,855	203,100	-	2,881,000	791,955
中國交通建設股份有限公司—A股	1,958,428	-	-	1,545,900	412,528
中國建設銀行股份有限公司—A股	11,659,891	-	-	8,986,900	2,672,991
中國光大銀行股份有限公司—A股	16,722,940	449,200	-	13,047,100	4,125,040
中國人壽保險股份有限公司—A股	1,779,411	27,100	-	1,366,800	439,711
招商銀行—A股	14,275,635	332,300	-	11,098,900	3,509,035
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	-	1,298,700	-	677,800	620,900
中國民生銀行—A股	30,104,999	376,000	-	23,644,500	6,836,499
中國核能電力股份有限公司—A股	4,569,600	224,300	-	3,644,400	1,149,500
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	3,136,669	-	-	2,388,700	747,969
中國石油化工股份有限公司—A股	18,131,096	-	-	15,309,600	2,821,496
中國鐵建股份有限公司—A股	3,564,025	307,600	-	2,755,100	1,116,525
中國中鐵股份有限公司—A股	5,756,035	1,127,500	-	5,233,500	1,650,035
中國神華能源股份有限公司—A股	2,557,557	-	-	1,964,200	593,357
中國船舶重工—A股	11,399,085	-	-	8,786,600	2,612,485
中國建築—A股	16,994,015	-	-	13,430,000	3,564,015
中國聯合網絡—A股	10,503,294	-	-	10,503,294	-
萬科企業股份有限公司—A股	10,093,916	-	-	10,093,916	-
中信證券股份有限公司—A股	9,787,924	-	-	7,483,400	2,304,524
中國中車股份有限公司—A股	11,898,992	-	-	9,583,500	2,315,492
大秦鐵路股份有限公司—A股	6,147,336	441,300	-	4,984,100	1,604,536
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	-	161,700	79,200	81,400	159,500
廣發證券股份有限公司—A股	3,115,008	-	-	2,417,100	697,908
珠海格力電器股份有限公司—A股	2,343,984	-	-	2,343,984	-
綠地控股集團股份有限公司—A股	-	429,200	-	22,500	406,700
廣州汽車集團股份有限公司—A股	-	129,600	-	25,100	104,500
國信證券股份有限公司—A股	1,410,046	103,600	-	1,156,100	357,546
國泰君安證券股份有限公司—A股	1,785,700	672,200	-	1,467,900	990,000
海通證券股份有限公司—A股	7,988,168	-	-	6,206,200	1,781,968
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	1,210,377	99,800	265,238	1,097,500	477,915
華能國際電力股份有限公司—A股	2,117,270	209,100	-	2,326,370	-
華泰證券股份有限公司—A股	3,172,753	102,100	-	2,499,400	775,453
中國工商銀行—A股	26,594,601	549,600	-	20,742,200	6,402,001
興業銀行股份有限公司—A股	14,898,339	686,000	-	11,514,300	4,070,039
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司—A股	9,147,800	881,400	-	10,029,200	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由 CREDIT SUISSE AG, NASSAU BRANCH 發行的 上市 CAAP(續)					
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	-	131,000	-	21,000	110,000
貴州茅台酒股份有限公司—A股	528,265	25,100	-	421,400	131,965
美的集團股份有限公司—A股	2,249,780	-	484,390	1,937,600	796,570
新華人壽保險股份有限公司—A股	724,217	-	-	559,200	165,017
中國石油天然氣股份有限公司—A股	5,175,118	-	-	3,955,000	1,220,118
平安銀行股份有限公司—A股	7,632,445	-	469,308	5,962,300	2,139,453
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	10,502,127	858,800	-	8,627,400	2,733,527
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	-	1,896,600	-	147,600	1,749,000
中國電力建設集團有限公司—A股	3,840,600	50,100	-	3,890,700	-
上海汽車集團股份有限公司—A股	2,515,907	346,700	-	2,175,100	687,507
上海電氣集團總公司—A股	2,727,405	-	-	2,727,405	-
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	3,871,755	-	-	2,937,400	934,355
上海浦東發展銀行—A股	12,211,521	-	367,922	9,438,900	3,140,543
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	470,800	75,100	116,000	430,900	231,000
申萬宏源集團股份有限公司—A股	3,710,600	904,000	478,870	3,395,500	1,697,970
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	4,696,102	-	-	4,696,102	-
宜賓五糧液股份有限公司—A股	-	669,600	-	152,600	517,000
浙江浙能電力股份有限公司—A股	2,879,900	-	-	2,879,900	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由HSBC BANK PLC發行的上市CAAP</b>					
中國農業銀行—A股	58,391,474	-	-	37,447,500	20,943,974
北京銀行股份有限公司—A股	-	6,967,800	1,319,280	1,874,100	6,412,980
中國銀行股份有限公司—A股	10,253,347	17,693,300	-	15,439,600	12,507,047
比亞迪股份有限公司—A股	488,500	135,900	-	295,600	328,800
中信銀行股份有限公司—A股	3,917,704	673,700	-	3,007,400	1,584,004
中國交通建設股份有限公司—A股	3,842,388	-	-	3,017,400	824,988
中國建設銀行股份有限公司—A股	4,686,882	7,294,100	-	6,635,000	5,345,982
中國光大銀行股份有限公司—A股	28,284,365	-	-	20,034,400	8,249,965
中國人壽保險股份有限公司—A股	1,675,088	264,300	-	1,062,500	876,888
招商銀行—A股	18,372,554	417,000	-	11,771,600	7,017,954
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	-	1,590,200	-	351,000	1,239,200
中國民生銀行—A股	36,187,797	117,700	-	22,632,500	13,672,997
中國核能電力股份有限公司—A股	4,663,200	482,000	-	2,846,200	2,299,000
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	6,050,727	-	-	4,554,700	1,496,027
中國石油化工股份有限公司—A股	4,732,494	7,958,800	-	7,048,300	5,642,994
中國鐵建股份有限公司—A股	4,057,407	771,700	-	2,596,100	2,233,007
中國中鐵股份有限公司—A股	6,143,890	1,247,500	-	4,091,400	3,299,990
中國神華能源股份有限公司—A股	3,303,788	56,000	-	2,176,800	1,182,988
中國船舶重工—A股	12,848,458	-	-	7,623,500	5,224,958
中國建築—A股	11,899,099	5,097,200	-	9,868,300	7,127,999
中國聯合網絡—A股	11,710,622	258,800	-	11,969,422	-
萬科企業股份有限公司—A股	10,301,618	-	-	10,301,618	-
中信證券股份有限公司—A股	13,401,031	271,300	-	9,063,300	4,609,031
中國中車股份有限公司—A股	13,553,481	270,400	-	9,192,900	4,630,981
大秦鐵路股份有限公司—A股	5,881,875	1,188,300	-	3,868,900	3,201,275
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	-	229,500	151,800	62,300	319,000
廣發證券股份有限公司—A股	3,135,647	-	-	1,743,600	1,392,047
珠海格力電器股份有限公司—A股	4,346,588	-	-	4,346,588	-
綠地控股集團股份有限公司—A股	-	954,600	-	142,500	812,100
廣州汽車集團股份有限公司—A股	-	248,400	-	39,400	209,000
國信證券股份有限公司—A股	1,785,707	-	-	1,070,700	715,007
國泰君安證券股份有限公司—A股	1,820,900	1,474,700	-	1,315,600	1,980,000
海通證券股份有限公司—A股	12,016,612	-	-	8,452,600	3,564,012
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	1,584,734	39,300	412,017	1,082,900	953,151
華能國際電力股份有限公司—A股	3,864,014	-	-	3,864,014	-
華泰證券股份有限公司—A股	3,196,922	140,100	-	1,786,000	1,551,022
中國工商銀行—A股	29,250,128	-	-	16,446,100	12,804,028
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司—A股	12,274,500	-	-	12,274,500	-
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	-	258,000	-	38,000	220,000
貴州茅台酒股份有限公司—A股	792,166	130,200	-	658,339	264,027
美的集團股份有限公司—A股	2,389,227	-	679,413	1,479,300	1,589,340

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由HSBC BANK PLC發行的上市CAAP(續)</b>					
新華人壽保險股份有限公司—A股	1,064,598	-	-	734,600	329,998
中國石油天然氣股份有限公司—A股	8,240,945	-	-	5,805,800	2,435,145
平安銀行股份有限公司—A股	7,144,749	1,001,100	930,969	4,797,800	4,279,018
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	485,027	6,155,000	-	2,628,200	4,011,827
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	-	4,218,300	-	720,300	3,498,000
中國電力建設集團有限公司—A股	4,268,400	-	-	4,268,400	-
上海汽車集團股份有限公司—A股	1,371,923	1,700,900	-	1,697,800	1,375,023
上海電氣集團總公司—A股	3,149,118	-	-	3,149,118	-
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	4,288,001	-	-	2,423,000	1,865,001
上海浦東發展銀行—A股	18,914,526	-	705,183	13,338,700	6,281,009
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	829,000	5,100	258,000	630,100	462,000
申萬宏源集團股份有限公司—A股	4,568,700	649,500	1,067,430	2,897,300	3,388,330
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	5,719,930	-	-	5,719,930	-
宜賓五糧液股份有限公司—A股	-	1,283,400	-	249,400	1,034,000
浙江浙能電力股份有限公司—A股	3,731,500	-	-	3,731,500	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由J.P. MORGAN STRUCTURED PRODUCTS</b>					
<b>B.V. 發行並由JP MORGAN CHASE BANK,</b>					
<b>N.A. 提供擔保的上市CAAP</b>					
中國農業銀行—A股	72,653,396	1,177,500	-	17,662,900	56,167,996
北京銀行股份有限公司—A股	-	16,204,200	3,240,840	2,246,500	17,198,540
中國銀行股份有限公司—A股	36,865,975	3,426,100	-	6,750,600	33,541,475
交通銀行股份有限公司—A股	34,925,746	6,212,800	-	9,278,500	31,860,046
比亞迪股份有限公司—A股	753,100	249,900	-	125,000	878,000
中信銀行股份有限公司—A股	5,473,400	290,000	-	1,515,400	4,248,000
中國交通建設股份有限公司—A股	2,685,926	68,300	-	541,700	2,212,526
中國建設銀行股份有限公司—A股	19,965,645	271,900	-	5,900,500	14,337,045
中國光大銀行股份有限公司—A股	32,686,349	475,500	-	11,036,800	22,125,049
中國人壽保險股份有限公司—A股	2,806,910	37,100	-	502,600	2,341,410
招商銀行—A股	22,520,757	407,400	-	4,107,200	18,820,957
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	-	3,695,100	-	389,400	3,305,700
中國民生銀行—A股	47,835,092	3,443,600	-	14,610,200	36,668,492
中國核能電力股份有限公司—A股	7,209,400	210,700	-	1,254,600	6,165,500
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	5,113,100	89,000	-	1,190,100	4,012,000
中國石油化工股份有限公司—A股	18,181,013	296,400	-	3,343,900	15,133,513
中國鐵建股份有限公司—A股	5,582,167	1,816,400	-	1,410,100	5,988,467
中國中鐵股份有限公司—A股	9,162,873	1,527,400	-	1,840,300	8,849,973
中國神華能源股份有限公司—A股	4,005,636	62,600	-	909,000	3,159,236
中國船舶重工—A股	16,288,417	1,093,000	-	3,368,900	14,012,517
中國建築—A股	22,386,608	549,700	-	3,820,300	19,116,008
中國聯合網絡—A股	17,189,889	-	-	17,189,889	-
萬科企業股份有限公司—A股	16,815,909	-	-	16,815,909	-
中信證券股份有限公司—A股	15,719,434	276,900	-	3,635,800	12,360,534
中國中車股份有限公司—A股	15,108,130	376,800	-	3,065,400	12,419,530
大秦鐵路股份有限公司—A股	10,598,870	157,600	-	2,213,900	8,542,570
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	-	552,200	372,900	75,400	849,700
廣發證券股份有限公司—A股	3,811,821	613,900	-	709,800	3,715,921
珠海格力電器股份有限公司—A股	3,669,848	-	-	3,669,848	-
綠地控股集團股份有限公司—A股	-	2,360,600	-	195,000	2,165,600
廣州汽車集團股份有限公司—A股	-	610,200	-	53,500	556,700
國信證券股份有限公司—A股	2,474,488	26,100	-	583,100	1,917,488
國泰君安證券股份有限公司—A股	2,817,400	3,254,100	-	761,500	5,310,000
海通證券股份有限公司—A股	10,262,565	1,221,500	-	1,926,100	9,557,965
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	2,134,953	26,900	940,227	558,200	2,543,880
華能國際電力股份有限公司—A股	3,820,129	58,000	-	3,878,129	-
華泰證券股份有限公司—A股	3,602,995	1,367,100	-	810,600	4,159,495
中國工商銀行—A股	41,512,854	679,000	-	7,853,900	34,337,954

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由J.P. MORGAN STRUCTURED PRODUCTS</b>					
<b>B.V. 發行並由JP MORGAN CHASE BANK,</b>					
<b>N.A. 提供擔保的上市CAAP(續)</b>					
興業銀行股份有限公司—A股	23,130,496	4,909,400	-	6,209,900	21,829,996
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司—A股	15,918,200	261,200	-	16,179,400	-
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	-	638,001	-	52,000	586,001
貴州茅台酒股份有限公司—A股	917,498	21,800	-	231,300	707,998
美的集團股份有限公司—A股	3,528,527	60,600	1,550,514	898,900	4,240,741
新華人壽保險股份有限公司—A股	878,766	204,000	-	197,800	884,966
中國石油天然氣股份有限公司—A股	8,268,809	129,700	-	1,901,700	6,496,809
平安銀行股份有限公司—A股	13,888,326	-	2,124,565	4,537,400	11,475,491
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	18,692,383	313,000	-	4,343,900	14,661,483
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	-	10,431,300	-	1,050,300	9,381,000
中國電力建設集團有限公司—A股	6,389,400	-	-	6,389,400	-
上海汽車集團股份有限公司—A股	4,666,235	79,000	-	1,057,700	3,687,535
上海電氣集團總公司—A股	3,154,506	1,105,500	-	4,260,006	-
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	6,615,606	112,600	-	1,752,400	4,975,806
上海浦東發展銀行—A股	19,534,820	-	1,732,292	4,422,600	16,844,512
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	771,500	86,100	638,000	256,600	1,239,000
申萬宏源集團股份有限公司—A股	6,584,800	1,381,700	2,622,165	1,548,000	9,040,665
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	7,638,790	-	-	7,638,790	-
宜賓五糧液股份有限公司—A股	-	3,152,700	-	379,700	2,773,000
浙江浙能電力股份有限公司—A股	5,188,500	-	-	5,188,500	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由MACQUARIE BANK LTD發行的上市CAAP</b>					
中國農業銀行-A股	28,588,052	-	-	4,597,700	23,990,352
北京銀行股份有限公司-A股	-	6,806,800	1,338,400	799,400	7,345,800
中國銀行股份有限公司-A股	16,373,431	-	-	2,047,200	14,326,231
交通銀行股份有限公司-A股	13,668,701	2,115,700	-	2,176,400	13,608,001
比亞迪股份有限公司-A股	313,300	85,800	-	24,100	375,000
中信銀行股份有限公司-A股	2,237,200	96,500	-	519,300	1,814,400
中國交通建設股份有限公司-A股	1,104,602	-	-	159,600	945,002
中國建設銀行股份有限公司-A股	7,034,359	-	-	910,800	6,123,559
中國光大銀行股份有限公司-A股	11,255,688	-	-	1,805,700	9,449,988
中國人壽保險股份有限公司-A股	1,127,820	-	-	128,500	999,320
招商銀行-A股	9,104,949	-	-	1,066,100	8,038,849
招商局蛇口工業區控股股份有限公司-A股	-	1,553,400	-	142,300	1,411,100
中國民生銀行-A股	18,891,922	799,400	-	4,029,500	15,661,822
中國核能電力股份有限公司-A股	2,990,600	6,800	-	364,000	2,633,400
中國太平洋保險(集團)股份有限公司-A股	2,045,143	-	-	331,500	1,713,643
中國石油化工股份有限公司-A股	7,424,707	-	-	960,900	6,463,807
中國鐵建股份有限公司-A股	2,218,156	714,000	-	374,400	2,557,756
中國中鐵股份有限公司-A股	3,936,570	285,900	-	442,500	3,779,970
中國神華能源股份有限公司-A股	1,603,750	-	-	255,200	1,348,550
中國船舶重工-A股	7,150,647	-	-	1,165,600	5,985,047
中國建築-A股	9,436,071	-	-	1,271,300	8,164,771
中國聯合網絡-A股	6,885,849	-	-	6,885,849	-
萬科企業股份有限公司-A股	6,694,599	-	-	6,694,599	-
中信證券股份有限公司-A股	6,297,311	-	-	1,017,900	5,279,411
中國中車股份有限公司-A股	6,312,021	-	-	1,007,400	5,304,621
大秦鐵路股份有限公司-A股	4,204,923	-	-	558,400	3,646,523
分眾傳媒信息技術股份有限公司-A股	-	230,100	154,000	21,600	362,500
廣發證券股份有限公司-A股	1,868,591	-	-	282,500	1,586,091
珠海格力電器股份有限公司-A股	1,467,611	-	-	1,467,611	-
綠地控股集團股份有限公司-A股	-	976,800	-	52,500	924,300
廣州汽車集團股份有限公司-A股	-	252,000	-	14,500	237,500
國信證券股份有限公司-A股	983,939	800	-	165,700	819,039
國泰君安證券股份有限公司-A股	1,167,800	1,308,000	-	207,800	2,268,000
海通證券股份有限公司-A股	4,855,424	-	-	773,000	4,082,424
杭州海康威視數字技術股份有限公司-A股	853,340	-	402,470	169,700	1,086,110
華能國際電力股份有限公司-A股	1,530,162	-	-	1,530,162	-
華泰證券股份有限公司-A股	1,853,870	209,000	-	286,300	1,776,570
中國工商銀行-A股	17,018,970	-	-	2,352,600	14,666,370
興業銀行股份有限公司-A股	8,489,551	1,890,100	-	1,055,700	9,323,951
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司-A股	6,499,200	-	-	6,499,200	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由MACQUARIE BANK LTD發行的上市CAAP(續)</b>					
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	-	264,000	-	14,000	250,000
貴州茅台酒股份有限公司—A股	360,404	-	-	58,000	302,404
美的集團股份有限公司—A股	1,390,142	-	663,721	243,500	1,810,363
新華人壽保險股份有限公司—A股	476,354	2,400	-	100,800	377,954
中國石油天然氣股份有限公司—A股	3,266,401	-	-	493,500	2,772,901
平安銀行股份有限公司—A股	4,855,425	-	909,465	863,500	4,901,390
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	7,178,321	-	-	916,100	6,262,221
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	-	4,316,400	-	309,600	4,006,800
中國電力建設集團有限公司—A股	2,522,100	-	-	2,522,100	-
上海汽車集團股份有限公司—A股	1,868,597	-	-	293,600	1,574,997
上海電氣集團總公司—A股	1,706,748	-	-	1,706,748	-
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	2,427,686	4,000	-	308,100	2,123,586
上海浦東發展銀行—A股	8,004,030	-	715,403	1,524,800	7,194,633
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	285,600	61,300	264,000	81,700	529,200
申萬宏源集團股份有限公司—A股	2,591,100	558,100	1,082,900	373,100	3,859,000
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	2,375,284	-	-	2,375,284	-
宜賓五糧液股份有限公司—A股	-	1,302,000	-	117,600	1,184,400
浙江浙能電力股份有限公司—A股	2,044,600	-	-	2,044,600	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由UBS AG LONDON BRANCH發行的上市CAAP</b>					
中國農業銀行—A股	33,763,789	-	-	21,197,400	12,566,389
北京銀行股份有限公司—A股	-	5,086,500	1,003,800	2,242,500	3,847,800
中國銀行股份有限公司—A股	31,616,086	11,543,386	-	35,655,286	7,504,186
交通銀行股份有限公司—A股	5,279,052	17,264,952	-	15,416,052	7,127,952
比亞迪股份有限公司—A股	234,200	64,100	-	298,300	-
中信銀行股份有限公司—A股	1,134,937	2,123,737	-	2,308,237	950,437
中國交通建設股份有限公司—A股	1,129,022	-	-	634,000	495,022
中國建設銀行股份有限公司—A股	10,092,188	4,959,888	-	11,844,488	3,207,588
中國光大銀行股份有限公司—A股	15,692,101	-	-	10,742,100	4,950,001
中國人壽保險股份有限公司—A股	983,421	792,021	-	1,250,721	524,721
招商銀行—A股	1,690,037	11,769,337	-	9,248,537	4,210,837
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	-	1,160,800	-	421,600	739,200
中國民生銀行—A股	5,242,631	22,766,531	-	19,805,331	8,203,831
中國核能電力股份有限公司—A股	2,235,300	59,400	-	2,294,700	-
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	766,984	2,093,084	-	1,962,484	897,584
中國石油化工股份有限公司—A股	11,585,974	5,237,074	-	13,437,274	3,385,774
中國鐵建股份有限公司—A股	314,600	1,853,300	-	2,167,900	-
中國中鐵股份有限公司—A股	3,133,880	152,100	-	3,285,980	-
中國神華能源股份有限公司—A股	433,178	1,812,578	-	1,539,578	706,178
中國船舶重工—A股	7,276,892	-	-	4,141,900	3,134,992
中國建築—A股	7,303,203	6,573,603	-	9,600,003	4,276,803
中國聯合網絡—A股	1,750,915	3,273,500	-	5,024,415	-
萬科企業股份有限公司—A股	1,442,751	-	-	1,442,751	-
中信證券股份有限公司—A股	981,460	7,854,660	-	6,070,760	2,765,360
中國中車股份有限公司—A股	3,267,322	1,333,100	-	4,600,422	-
大秦鐵路股份有限公司—A股	1,713,210	4,336,410	-	4,138,910	1,910,710
分眾傳媒信息技術股份有限公司—A股	-	172,200	115,500	96,300	191,400
廣發證券股份有限公司—A股	267,532	1,089,300	-	1,356,832	-
珠海格力電器股份有限公司—A股	2,260,477	-	-	2,260,477	-
綠地控股集團股份有限公司—A股	-	732,600	-	247,500	485,100
廣州汽車集團股份有限公司—A股	-	189,000	-	63,600	125,400
國信證券股份有限公司—A股	713,753	600	-	285,400	428,953
國泰君安證券股份有限公司—A股	872,800	1,009,200	-	1,882,000	-
海通證券股份有限公司—A股	2,811,952	3,540,352	-	6,352,304	-
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	412,808	212,600	300,754	926,162	-
華能國際電力股份有限公司—A股	718,559	394,400	-	1,112,959	-
華泰證券股份有限公司—A股	1,803,108	161,500	-	1,034,000	930,608
中國工商銀行—A股	19,189,236	11,820,636	-	23,327,436	7,682,436
興業銀行股份有限公司—A股	3,127,057	12,143,457	-	10,386,557	4,883,957
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司—A股	4,784,800	45,100	-	4,829,900	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由UBS AG LONDON BRANCH發行的上市CAAP</b>					
<b>(續)</b>					
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	-	198,000	-	66,000	132,000
貴州茅台酒股份有限公司—A股	151,233	361,333	-	354,133	158,433
美的集團股份有限公司—A股	1,018,247	20,600	495,973	1,534,820	-
新華人壽保險股份有限公司—A股	335,269	1,800	-	139,100	197,969
中國石油天然氣股份有限公司—A股	984,659	3,587,459	-	3,116,859	1,455,259
平安銀行股份有限公司—A股	3,604,502	-	679,620	4,284,122	-
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	14,562,555	5,048,955	-	16,331,355	3,280,155
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	-	3,237,300	-	1,138,500	2,098,800
中國電力建設集團有限公司—A股	1,856,900	-	-	1,856,900	-
上海汽車集團股份有限公司—A股	2,558,297	1,267,197	-	3,000,497	824,997
上海電氣集團總公司—A股	1,991,914	-	-	1,991,914	-
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	2,497,741	3,000	-	2,500,741	-
上海浦東發展銀行—A股	2,519,141	9,112,295	536,554	8,399,395	3,768,595
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	199,100	61,300	198,000	181,200	277,200
申萬宏源集團股份有限公司—A股	1,907,600	445,700	812,175	1,142,600	2,022,875
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	2,265,253	-	-	2,265,253	-
宜賓五糧液股份有限公司—A股	-	976,500	-	356,100	620,400
浙江浙能電力股份有限公司—A股	1,505,300	10,500	-	1,515,800	-
<b>由HSBC BANK PLC發行的非上市指數掛鈎認股</b>					
<b>權證</b>					
富時中國A50指數	68,578	102,500	-	171,078	-

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 所持有之抵押品(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

抵押品提供者	抵押品提供者之信貸評級 <sup>1</sup>	抵押品之性質	抵押品所覆蓋之資產淨值百分比	抵押品之價值 港元
Citigroup Global Markets Limited	A+	固定收入證券	4.00%	1,151,414,050
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	A	上市股本	4.52%	1,301,853,646
HSBC Bank plc	AA-	固定收入證券	0.26%	73,632,874
		上市股本	1.56%	450,904,992
J.P. Morgan Securities plc 由JP Morgan Chase Bank, N.A. 提供擔保	A+	固定收入證券	5.97%	1,721,282,185
		上市股本	4.72%	1,360,278,207
Macquarie Bank Ltd	A	固定收入證券	18.17%	5,235,044,429
		上市股本	11.08%	3,193,566,667
UBS AG London	A+	固定收入證券	0.00%	186
		上市股本	4.75%	1,368,729,390
			55.03%	15,856,706,626

<sup>1</sup> 標準普爾評級服務公司對優先長期債務的信貸評級

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 所持有之抵押品(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

### 固定收入抵押品之信貸評級

抵押品提供者	評級機構	信貸評級	抵押品所覆蓋之資產淨值百分比	抵押品之價值 港元
Citigroup Global Markets Limited	穆迪 <sup>2</sup>	Aaa	2.84%	818,415,874
		Aa2	1.16%	332,998,176
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	穆迪 <sup>2</sup>	Aaa	0.26%	73,632,874
HSBC Bank plc	穆迪 <sup>2</sup>	Aaa	0.93%	269,396,755
		Aa1	5.04%	1,451,885,430
J.P. Morgan Securities plc，由JP Morgan Chase Bank, N.A. 提供擔保	穆迪 <sup>2</sup>	Aaa	13.57%	3,910,094,250
		Aa2	4.60%	1,324,950,179
Macquarie Bank Limited	穆迪 <sup>2</sup>	Aaa	0.00%	186
			28.40%	8,181,373,724

<sup>2</sup> 穆迪評級服務公司對長期債務的信貸評級

# iShares安碩富時A50中國指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 港元	成分基金交易 資產淨值 港元
截至下列日期財務期間結束時		
二零一四年十二月三十一日	14.00	88,566,777,395
二零一五年十二月三十一日	12.24	42,960,355,219
二零一六年十二月三十一日	10.86	28,814,166,352

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 港元	最低每單位 資產淨值 港元
截至下列日期止財務期間		
二零零七年十二月三十一日	27.61*	10.53*
二零零八年十二月三十一日	26.54	7.64
二零零九年十二月三十一日	16.49	8.39
二零一零年十二月三十一日	14.69	10.46
二零一一年十二月三十一日	12.73	9.45
二零一二年十二月三十一日	10.85	8.79
二零一三年十二月三十一日	11.55	8.53
二零一四年十二月三十一日	14.00	7.84
二零一五年十二月三十一日	18.18	9.99
二零一六年十二月三十一日	11.99	9.70

\*為年內單位分拆的影響所作的調整。

# iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## iShares BSE SENSEX Mauritius Company 投資組合 (未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.77%)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>印度(99.77%)</b>			
<b>投資基金</b>			
iShares BSE SENSEX Mauritius Company	42,499,125	797,797,824	99.77
投資總額		797,797,824	99.77
其他資產淨值		1,804,294	0.23
<b>基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值</b>			
		799,602,118	100.00
投資總額(按成本)		642,735,077	

# iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合 (未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>印度(99.71%)</b>			
<b>上市股本</b>			
Adani Ports and Special Econ	254,561	7,796,309	0.98
Asian Paints Ltd	128,872	13,122,216	1.64
Axis Bank Ltd	477,853	24,564,457	3.08
Bajaj Auto Ltd	38,877	11,697,259	1.47
Bharti Airtel Ltd	377,089	13,153,524	1.65
Cipla Ltd	145,913	9,470,994	1.19
Coal India Ltd	361,119	12,375,762	1.55
瑞迪博士實驗室	35,020	12,235,591	1.53
蓋爾印度有限公司	135,342	6,771,072	0.85
HDFC Bank Limited	578,352	79,559,346	9.97
Hero Motocorp Ltd	36,534	12,707,181	1.59
Hindustan Unilever Ltd	204,162	19,271,388	2.42
Housing Development Finance	452,243	65,220,839	8.17
ICICI Bank Ltd	1,662,946	48,498,611	6.08
Infosys Ltd	571,245	65,954,589	8.27
ITC Ltd	2,419,316	66,591,664	8.35
Larsen & Toubro Ltd	229,161	35,324,966	4.43
Lupin Ltd	68,326	11,580,637	1.45
Mahindra & Mahindra Ltd	133,159	18,017,212	2.26
Maruti Suzuki India Ltd	37,995	23,103,791	2.90
NTPC Ltd	707,113	13,304,016	1.67
Oil & Natural Gas Corp Ltd	770,385	16,848,589	2.11
Power Grid Corp of India Ltd	628,110	13,162,966	1.65
Reliance Industries Ltd	472,785	58,334,838	7.31
State Bank of India	887,626	25,324,207	3.17
Sun Pharmaceutical Indus	309,589	22,271,734	2.79
Tata Consultancy Svcs Ltd	152,082	41,034,472	5.14
Tata Motors Ltd	552,974	29,774,780	3.73
Tata Steel Ltd	193,255	8,634,136	1.08
Wipro Ltd	180,664	9,782,510	1.23
投資總額		795,489,656	99.71
其他資產淨值		2,309,106	0.29
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		797,798,762	100.00

# iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF(前稱iShares安碩標普BSE SENSEX印度指數ETF)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>投資基金</b>					
iShares BSE SENSEX Mauritius Company	44,275,592	757,816	-	2,534,283	42,499,125

# iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF (前稱 iShares 安碩標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 港元	成分基金交易 資產淨值 港元
截至下列日期財務期間結束時		
二零一四年十二月三十一日	19.54	1,340,170,506
二零一五年十二月三十一日	17.77	828,098,456
二零一六年十二月三十一日	17.77	799,612,920

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 港元	最低每單位 資產淨值 港元
截至下列日期止財務期間		
二零零七年十二月三十一日(自成立以來)	23.20	12.56
二零零八年十二月三十一日	23.87	7.54
二零零九年十二月三十一日	16.54	6.98
二零一零年十二月三十一日	20.86	14.92
二零一一年十二月三十一日	20.29	12.69
二零一二年十二月三十一日	16.57	12.58
二零一三年十二月三十一日	16.58	11.80
二零一四年十二月三十一日	20.75	14.43
二零一五年十二月三十一日	21.59	16.80
二零一六年十二月三十一日	19.82	15.09

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)</b>			
<b>中國(36.14%)</b>			
三生製藥	165,436	1,249,042	0.03
58 同城 – ADR	12,739	2,765,487	0.07
瑞聲科技控股有限公司	118,390	8,340,575	0.20
中國農業銀行 – H 股	4,014,710	12,766,778	0.30
友邦保險控股有限公司	1,972,974	86,317,612	2.05
中國國際航空股份有限公司 – H 股	313,424	1,551,449	0.04
阿里巴巴集團控股有限公司 – SP ADR	183,886	125,190,343	2.97
中國鋁業股份有限公司 – H 股	701,070	2,243,424	0.05
安徽海螺水泥股份有限公司 – H 股	202,267	4,267,834	0.10
安踏體育用品有限公司	175,169	4,055,162	0.10
Asm Pacific Technology	43,669	3,587,408	0.09
中國航空科技工業 – H 股	350,631	1,872,370	0.04
百度股份有限公司 – Spon ADR	44,706	56,986,532	1.35
中國銀行股份有限公司 – H 股	13,067,144	44,950,975	1.07
交通銀行股份有限公司 – H 股	1,463,632	8,210,976	0.20
東亞銀行	193,625	5,750,662	0.14
北京首都國際機場 – H 股	262,272	2,056,212	0.05
北京控股有限公司	87,731	3,215,341	0.08
北控水務集團有限公司	669,548	3,454,868	0.08
百麗國際控股有限公司	1,046,547	4,562,945	0.11
中國銀行(香港)有限公司	604,952	16,787,418	0.40
華晨中國汽車控股有限公司	524,672	5,603,497	0.13
比亞迪股份有限公司 – H 股	109,069	4,455,469	0.11
國泰航空有限公司	218,303	2,226,691	0.05
中國廣核電力股份有限公司 – H 股	1,647,112	3,508,349	0.08
中國信達資產管理股份有限公司 – H 股	1,423,144	3,999,035	0.10
中信銀行股份有限公司 – H 股	1,490,272	7,347,041	0.17
中國中煤能源股份有限公司 – H 股	204,339	751,968	0.02
中國交通建設股份有限公司 – H 股	753,346	6,719,846	0.16
中國通信服務股份有限公司 – H 股	436,441	2,156,019	0.05
中國海螺創業控股有限公司	221,892	3,062,110	0.07
中國建設銀行 – H 股	13,702,672	81,804,952	1.94
中國光大銀行股份有限公司 – H 股	506,535	1,788,069	0.04
中國光大國際有限公司	437,569	3,846,232	0.09
中國光大控股有限公司	151,993	2,243,417	0.05
中國恒大集團(前稱恒大地產集團)	691,823	3,341,505	0.08
中國銀河證券股份有限公司 – H 股	472,453	3,302,446	0.08
中國華融資產管理 – H 股	825,384	2,302,821	0.05
中國輝山乳業控股有限公司	525,800	1,582,658	0.04
中國金茂控股集團有限公司	612,903	1,280,967	0.03

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>中國(36.14%)(續)</b>			
中國人壽保險股份有限公司—H股	1,221,614	24,676,603	0.59
龍源電力集團股份有限公司—H股	568,870	3,447,352	0.08
康哲藥業控股有限公司	218,303	2,680,761	0.06
中國蒙牛乳業有限公司	449,216	6,711,287	0.16
招商銀行—H股	626,834	11,395,842	0.27
招商局港口控股有限公司(前稱招商局國際有限公司)	227,449	4,376,119	0.10
中國民生銀行—H股	990,106	8,207,979	0.20
中國移動有限公司	1,005,992	82,692,542	1.96
中國建材股份有限公司—H股	524,672	1,978,013	0.05
中海油田服務股份有限公司—H股	297,383	2,141,158	0.05
中國海外發展有限公司	640,272	13,157,590	0.31
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—H股	431,687	11,677,133	0.28
中國石油化工股份有限公司—H股	4,172,748	22,950,114	0.55
中國電力國際發展有限公司	568,870	1,598,525	0.04
中國鐵建股份有限公司—H股	325,615	3,249,638	0.08
中國中鐵股份有限公司—H股	647,139	4,128,747	0.10
華潤啤酒(控股)有限公司	271,316	4,178,266	0.10
華潤燃氣控股有限公司	136,933	2,985,139	0.07
華潤置地有限公司	471,264	8,218,844	0.20
華潤電力控股有限公司	320,917	3,953,697	0.09
中國神華能源股份有限公司—H股	562,897	8,218,296	0.20
中國南方航空股份有限公司—H股	350,631	1,413,043	0.03
中國建築國際集團有限公司	262,272	3,042,355	0.07
中國太平保險控股有限公司	267,297	4,276,752	0.10
中國電信股份有限公司—H股	2,191,307	7,844,879	0.19
中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司	964,361	8,708,180	0.21
萬科企業股份有限公司—H股	214,309	3,793,269	0.09
重慶長安汽車股份有限公司—B股	136,610	1,515,005	0.04
重慶農村商業銀行—H股	411,919	1,874,231	0.04
中國中信股份有限公司	714,948	7,935,923	0.19
中信證券股份有限公司—H股	353,434	5,570,120	0.13
中電控股有限公司	269,906	19,230,802	0.46
中國海洋石油有限公司	2,923,025	28,353,342	0.67
碧桂園控股有限公司	929,210	4,032,771	0.10
中國中車股份有限公司—H股	672,554	4,680,976	0.11
石藥集團有限公司	612,903	5,074,837	0.12
攜程旅行網—ADR	61,978	19,220,989	0.46
東風汽車集團股份有限公司—H股	436,460	3,304,002	0.08
新奧能源控股有限公司	120,761	3,852,276	0.09
遠東宏信有限公司	306,369	2,037,354	0.05

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>中國(36.14%)(續)</b>			
復星國際有限公司	389,987	4,282,057	0.10
福耀玻璃工業集團股份有限公司—H 股	78,880	1,897,064	0.05
保利協鑫能源控股有限公司	2,016,074	1,874,949	0.04
吉利汽車控股有限公司	876,299	6,493,376	0.15
廣發證券股份有限公司—H 股	236,560	3,827,541	0.09
國美電器控股有限公司	2,208,865	2,076,333	0.05
長城汽車股份有限公司—H 股	460,200	3,331,848	0.08
粵海投資有限公司	456,200	4,671,488	0.11
廣州汽車集團股份有限公司—H 股	336,605	3,157,355	0.08
廣州富力地產股份有限公司—H 股	157,735	1,479,554	0.04
海爾電器集團有限公司	218,303	2,663,297	0.06
海天國際控股有限公司	87,976	1,338,995	0.03
海通證券股份有限公司—H 股	495,874	6,595,124	0.16
恒隆集團有限公司	145,080	3,917,160	0.09
恒生銀行有限公司	125,131	18,056,403	0.43
恒安國際集團有限公司	118,390	6,742,310	0.16
香港中華煤氣	1,249,170	17,163,596	0.41
華能國際電力股份有限公司—H 股	612,903	3,150,321	0.07
華能新能源股份有限公司—H 股	701,070	1,766,696	0.04
華泰證券股份有限公司—H 股	192,288	2,845,862	0.07
中國工商銀行—H 股	12,117,295	56,345,422	1.34
京東商城電子商務有限公司—ADR	110,065	21,709,236	0.52
江蘇寧滬高速公路股份有限公司—H 股	199,685	1,956,913	0.05
江西銅業股份有限公司—H 股	205,982	2,228,725	0.05
金山軟件有限公司	124,123	1,973,556	0.05
昆侖能源有限公司	497,639	2,886,306	0.07
聯想集團有限公司	1,225,744	5,760,997	0.14
龍湖地產	262,900	2,586,936	0.06
新濠博亞娛樂有限公司—ADR	31,359	3,865,783	0.09
香港鐵路有限公司	239,352	9,023,570	0.21
網易公司—ADR	13,038	21,767,767	0.52
新華人壽保險股份有限公司—H 股	128,892	4,588,555	0.11
新東方教育科技集團—SP ADR	22,022	7,188,149	0.17
玖龍紙業(控股)有限公司	306,369	2,153,774	0.05
中國人民保險集團股份有限公司—H 股	1,226,872	3,754,228	0.09
中國石油天然氣股份有限公司—H 股	3,449,056	19,935,544	0.47
中國人民財產保險股份有限公司—H 股	755,727	9,129,182	0.22
中國平安保險(集團)股份有限公司—H 股	858,240	33,299,712	0.79
Qunar Cayman Islands Ltd—ADR	5,761	1,345,783	0.03
金沙中國有限公司	397,225	13,386,483	0.32
中芯國際集成電路製造有限公司	426,866	5,199,228	0.12

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>中國(36.14%)(續)</b>			
山東威高集團醫用高分子製品股份有限公司—H股	348,375	1,804,583	0.04
上海電氣集團總公司—H股	524,672	1,820,612	0.04
上海復星醫藥(集團)股份有限公司—H股	65,600	1,558,000	0.04
上海實業控股有限公司	87,103	1,829,163	0.04
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司—B股	119,310	1,354,241	0.03
上海醫藥集團股份有限公司—H股	127,191	2,261,456	0.05
香格里拉(亞洲)有限公司	200,256	1,638,094	0.04
申洲國際集團	87,103	4,272,402	0.10
世茂房地產控股有限公司	193,800	1,965,132	0.05
新浪公司	9,324	4,394,532	0.10
中國生物製藥有限公司	788,068	4,302,851	0.10
遠洋集團控股有限公司(前稱遠洋地產控股有限公司)	239,551	831,242	0.02
中石化煉化工程(集團)股份有限公司—H股	218,803	1,415,655	0.03
中國石化上海石油化工股份有限公司—H股	612,903	2,574,193	0.06
國藥控股股份有限公司—H股	195,513	6,246,640	0.15
中國外運股份有限公司—H股	350,631	1,213,183	0.03
Soho中國有限公司	394,100	1,505,462	0.04
高鑫零售有限公司	390,461	2,655,135	0.06
融創中國控股有限公司	350,631	2,261,570	0.05
舜宇光學科技(集團)有限公司	117,392	3,985,458	0.09
好未來教育集團—ADR	6,876	3,739,743	0.09
騰訊控股有限公司	929,974	176,416,068	4.19
康師傅控股有限公司	350,631	3,306,450	0.08
中國民航信息網絡股份有限公司—H股	131,200	2,138,560	0.05
青島啤酒股份有限公司—H股	48,803	1,429,928	0.03
唯品會控股有限公司—ADR	65,977	5,631,941	0.13
中國旺旺控股有限公司	952,824	4,735,535	0.11
新浪微博—Spon ADR	5,277	1,661,083	0.04
濰柴動力股份有限公司—H股	175,169	2,091,518	0.05
豐益國際有限公司	312,508	6,020,827	0.14
揚子江船業(控股)有限公司	355,040	1,552,871	0.04
兗州煤業股份有限公司—H股	350,631	1,854,838	0.04
百勝中國控股有限公司	65,437	13,251,796	0.31
歡聚時代—ADR	4,863	1,486,275	0.04
浙江滬杭甬高速公路股份有限公司—H股	262,272	1,940,813	0.05
株洲中車時代電氣股份有限公司—H股(前稱株洲南車時代電氣股份有限公司—H股)	87,731	3,452,215	0.08
紫金礦業集團股份有限公司—H股	1,051,602	2,629,005	0.06
中興通訊股份有限公司—H股	140,311	1,891,392	0.04
		1,522,428,896	36.14

# iShares安碩核心MSCI亞洲(日本除外)指數ETF(前稱iShares安碩MSCI亞洲(日本除外)指數ETF)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>香港(7.50%)</b>			
阿里巴巴健康信息技術有限公司	436,441	1,702,120	0.04
阿里巴巴影業集團有限公司	1,752,672	2,208,367	0.05
長江基建集團有限公司	104,432	6,443,454	0.15
長江實業地產有限公司	441,966	21,015,483	0.50
中國燃氣控股有限公司	274,029	2,882,785	0.07
長江和記實業有限公司	444,747	39,093,261	0.93
中遠海運港口有限公司(前稱中遠太平洋有限公司)	262,413	2,044,197	0.05
豐盛控股有限公司	1,121,684	4,060,496	0.10
銀河娛樂集團有限公司	383,629	12,966,660	0.31
恒隆地產有限公司	354,760	5,832,254	0.14
恒基兆業地產有限公司	177,518	7,322,618	0.17
恒騰網絡集團有限公司	3,638,176	1,418,889	0.03
港燈電力投資有限公司—SS股	381,280	2,440,192	0.06
香港電訊信託與香港電訊有限公司—SS股	431,785	4,106,275	0.10
香港交易及結算所有限公司	188,378	34,510,850	0.82
香港置地有限公司	193,426	9,492,853	0.22
希慎興業有限公司	104,432	3,347,046	0.08
怡和控股有限公司	40,802	17,478,008	0.41
嘉里建設有限公司	109,069	2,295,902	0.05
利豐有限公司	1,051,602	3,585,963	0.08
領展房地產投資信託基金	367,973	18,545,839	0.44
美高梅(中國)控股有限公司	174,969	2,813,502	0.07
新世界發展有限公司	952,655	7,811,771	0.19
新創建集團有限公司	257,321	3,252,537	0.08
電訊盈科有限公司	745,227	3,129,953	0.07
電能實業有限公司	226,414	15,475,397	0.37
信和置業有限公司	524,672	6,096,689	0.14
澳門博彩控股有限公司	350,631	2,131,837	0.05
新鴻基地產發展有限公司	237,823	23,306,654	0.55
太古股份有限公司—CLA股	89,109	6,598,521	0.16
太古地產有限公司	189,527	4,055,878	0.10
創科實業有限公司	236,260	6,568,028	0.16
萬州國際有限公司	1,272,823	7,980,600	0.19
九龍倉集團有限公司	218,829	11,280,635	0.27
會德豐有限公司	131,200	5,726,880	0.14
永利澳門有限公司	255,097	3,147,897	0.07
裕元工業(集團)有限公司	131,200	3,693,280	0.09
		315,863,571	7.50

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>印尼(3.24%)</b>			
Adaro Energy TBK PT	2,682,701	2,616,809	0.06
Akr Corporindo TBK PT	292,338	1,009,408	0.02
Astra International TBK PT	3,311,046	15,767,513	0.37
Bank Central Asia TBK PT	2,016,783	17,989,573	0.43
Bank Danamon Indonesia TBK	618,050	1,319,555	0.03
Bank Mandiri Persero TBK PT	1,564,953	10,424,429	0.25
Bank Negara Indonesia Perser	1,240,134	3,943,037	0.09
Bank Rakyat Indonesia Perser	1,804,231	12,122,132	0.29
Bumi Serpong Damai PT	1,354,452	1,367,952	0.03
Charoen Pokphand Indonesi PT	1,363,344	2,424,342	0.06
Gudang Garam TBK PT	78,796	2,897,577	0.07
Hm Sampoerna TBK PT	1,512,252	3,333,135	0.08
Indocement Tunggal Prakarsa	271,892	2,409,612	0.06
Indofood Cbp Sukses Makmur T	429,591	2,119,919	0.05
Indofood Sukses Makmur TBK P	686,193	3,129,504	0.07
怡和合發有限公司	15,595	3,450,637	0.08
Jasa Marga (Persero) TBK PT	405,211	1,007,384	0.02
Kalbe Farma TBK PT	3,453,981	3,011,359	0.07
Lippo Karawaci TBK PT	3,620,710	1,500,225	0.04
Matahari Department Store TB	388,114	3,378,195	0.08
Media Nusantara Citra TBK PT	931,016	940,295	0.02
Pakuwon Jati TBK PT	3,969,098	1,290,537	0.03
Perusahaan Gas Negara Perser	1,786,139	2,775,294	0.07
Semen Indonesia Persero TBK	485,598	2,563,970	0.06
Summarecon Agung TBK PT	1,863,046	1,420,592	0.03
Surya Citra Media PT TBK	1,078,302	1,737,515	0.04
Telekomunikasi Indonesia Per	8,244,947	18,884,302	0.45
Tower Bersama Infrastructure	355,050	1,017,534	0.02
Unilever Indonesia TBK PT	253,708	5,664,947	0.14
United Tractors TBK PT	261,824	3,201,831	0.08
Waskita Karya Persero TBK PT	781,921	1,147,448	0.03
XI Axiata TBK PT	557,560	741,197	0.02
		136,607,759	3.24
<b>馬來西亞(3.01%)</b>			
Airasia BHD	206,129	815,818	0.02
Alliance Financial Group BHD	201,508	1,295,550	0.03
AMMB Holdings BHD	291,118	2,168,529	0.05
Astro Malaysia Holdings BHD	289,300	1,299,992	0.03
Axiata Group Berhad	473,400	3,861,795	0.09
Berjaya Sports Toto BHD	124,510	636,964	0.02

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>馬來西亞(3.01%)(續)</b>			
British American Tobacco BHD	22,042	1,699,045	0.04
Cimb Group Holdings BHD	460,549	3,589,809	0.09
Dialog Group BHD	497,256	1,323,487	0.03
Digi.Com BHD	568,987	4,749,725	0.11
Felda Global Ventures	236,700	634,087	0.01
Gamuda BHD	302,450	2,498,621	0.06
Genting BHD	365,237	5,049,911	0.12
Genting Malaysia BHD	464,138	3,673,936	0.09
Genting Plantations BHD	42,080	785,450	0.02
Hap Seng Consolidated	92,560	1,417,346	0.03
Hartalega Holdings BHD	107,952	901,149	0.02
Hong Leong Bank Berhad	85,162	1,987,003	0.05
Hong Leong Financial Group	43,083	1,058,826	0.03
IHH Healthcare BHD	549,242	6,027,766	0.14
IJM Corp BHD	462,797	2,559,526	0.06
IOI Corp BHD	356,078	2,707,801	0.06
IOI Properties Group BHD	281,410	1,021,357	0.02
Kuala Lumpur Kepong BHD	69,904	2,899,561	0.07
Lafarge Malaysia BHD	71,010	882,404	0.02
Malayan Banking BHD	541,990	7,681,112	0.18
Malaysia Airports Hldgs BHD	122,270	1,280,594	0.03
Maxis BHD	307,446	3,177,525	0.08
MISC BHD	206,142	2,618,622	0.06
Petronas Chemicals Group BHD	382,671	4,616,363	0.11
Petronas Dagangan BHD	27,976	1,150,751	0.03
Petronas Gas BHD	112,797	4,152,371	0.10
PPB Group Berhad	87,792	2,406,451	0.06
Public Bank Berhad	440,838	15,024,668	0.36
RHB Bank BHD	146,866	1,195,532	0.03
Sapurkencana Petroleum BHD	609,259	1,705,831	0.04
Sime Darby Berhad	380,788	5,330,737	0.13
Telekom Malaysia BHD	206,142	2,119,837	0.05
Tenaga Nasional BHD	553,812	13,304,425	0.32
UMW Holdings BHD	109,458	864,535	0.02
Westports Holdings BHD	188,358	1,399,818	0.03
YTL Corp BHD	793,355	2,125,290	0.05
YTL Power International BHD	344,530	887,222	0.02
		126,587,142	3.01

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>菲律賓(1.50%)</b>			
Aboitiz Equity Ventures Inc	310,271	3,425,997	0.08
Aboitiz Power Corp	271,892	1,768,256	0.04
Alliance Global Group Inc	377,092	751,607	0.02
Ayala Corporation	39,763	4,530,143	0.11
Ayala Land Inc	1,221,527	6,096,290	0.14
Bank of The Philippine Islan	90,911	1,259,047	0.03
BDO Unibank Inc	259,014	4,528,365	0.11
DMCI Holdings Inc	736,400	1,522,895	0.04
Energy Development Corp	1,731,544	1,390,764	0.03
第一太平有限公司	355,513	1,926,880	0.04
Globe Telecom Inc	6,262	1,473,720	0.03
GT Capital Holdings Inc	14,465	2,865,067	0.07
Intl Container Term Svcs Inc	93,678	1,051,189	0.02
JG Summit Holdings Inc	462,880	4,883,698	0.12
Jollibee Foods Corp	78,900	2,387,214	0.06
Megaworld Corp	2,104,105	1,171,516	0.03
Metro Pacific Investments Co	2,454,792	2,549,773	0.06
Metropolitan Bank & Trust	105,618	1,195,879	0.03
PLDT Inc(前稱 Philippine Long Distance Tel)	15,788	3,361,030	0.08
Robinsons Land Co	269,575	1,093,114	0.03
Security Bank Corp	19,618	581,328	0.01
SM Investments Corp	37,905	3,872,134	0.09
SM Prime Holdings Inc	1,348,189	5,960,963	0.14
Universal Robina Corp	141,901	3,618,393	0.09
		63,265,262	1.50
<b>新加坡(4.24%)</b>			
Ascendas Real Estate Inv Trt	377,071	4,593,561	0.11
Capitaland Commercial Trust	381,280	3,028,351	0.07
Capitaland Ltd	426,239	6,908,133	0.16
Capitaland Mall Trust	392,104	3,966,552	0.09
城市發展有限公司	74,611	3,315,383	0.08
康福德高企業有限公司	349,916	4,638,326	0.11
星展集團控股有限公司	291,409	27,117,683	0.64
Genting Singapore Plc	984,574	4,781,867	0.11
Global Logistic Properties L	424,614	5,013,229	0.12
金光農業資源有限公司	1,301,782	3,004,051	0.07
和記港口集團有限公司—U股	841,664	2,838,613	0.07
吉寶企業有限公司	241,792	7,513,132	0.18
華僑銀行有限公司	509,742	24,401,459	0.58

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>新加坡(4.24%)(續)</b>			
Sats Ltd	111,052	2,890,471	0.07
勝科工業	179,771	2,749,572	0.07
新加坡航空公司	87,731	4,552,816	0.11
新加坡交易所有限公司	121,254	4,659,182	0.11
Singapore Press Holdings Ltd	11,800	223,541	0.00
Singapore Tech Engineering	259,428	4,496,969	0.11
新加坡電信	1,324,409	25,942,721	0.62
Starhub Ltd	109,369	1,649,305	0.04
Suntec Reit	438,169	3,879,950	0.09
大華銀行有限公司	214,777	23,513,564	0.56
UOL Group Ltd	87,731	2,820,203	0.07
		178,498,634	4.24
<b>南韓(17.12%)</b>			
Amorepacific Corp - 優先股	1,626	2,144,942	0.05
Amorepacific Corp	5,259	10,853,437	0.26
Amorepacific Group	4,756	4,060,473	0.10
BGF Retail Co Ltd	3,046	1,599,434	0.04
BNK Financial Group Inc	42,636	2,375,633	0.06
Celltrion Inc	13,329	9,189,355	0.22
Cheil Worldwide Inc	11,354	1,147,923	0.03
CJ Cheiljedang Corp	1,295	2,971,864	0.07
CJ Corp	2,631	3,158,244	0.07
CJ E&M Corp	2,733	1,243,853	0.03
CJ Korea Express Corp	1,314	1,509,842	0.04
Coway Co Ltd	8,097	4,589,528	0.11
Daelim Industrial Co Ltd	5,156	2,882,798	0.07
Daewoo Engineering & Constr	19,516	636,411	0.01
DGB Financial Group Inc	31,249	1,959,809	0.05
Dongbu Insurance Co Ltd	7,683	3,082,436	0.07
Dongsuh Companies Inc	6,471	1,144,396	0.03
Doosan Heavy Industries	8,996	1,570,730	0.04
E-Mart Inc	3,045	3,577,021	0.08
GS Engineering & Construct	9,204	1,565,690	0.04
GS Holdings	8,321	2,889,721	0.07
GS Retail Co Ltd	3,842	1,173,944	0.03
Hana Financial Group	48,561	9,741,387	0.23
Hankook Tire Co Ltd	12,267	4,567,195	0.11
Hanmi Pharm Co Ltd	898	1,761,046	0.04
Hanmi Science Co Ltd	2,214	868,364	0.02
Hanon Systems	34,397	2,274,264	0.05

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>南韓(17.12%)(續)</b>			
Hanssem Co Ltd	1,628	2,079,652	0.05
Hanwha Chemical Corp	19,516	3,094,361	0.07
Hanwha Corporation	8,202	1,845,402	0.04
Hanwha Life Insurance Co Ltd	40,250	1,687,183	0.04
Hanwha Techwin Co Ltd	6,202	1,729,835	0.04
Hotel Shilla Co Ltd	6,159	1,903,661	0.04
Hyosung Corporation	3,522	3,289,543	0.08
Hyundai Dept Store Co	2,735	1,913,670	0.05
Hyundai Development Co-Engin	8,094	2,335,479	0.06
Hyundai Engineering & Const	10,073	2,767,488	0.07
Hyundai Glovis Co Ltd	3,027	3,002,092	0.07
Hyundai Heavy Industries	6,768	6,321,301	0.15
Hyundai Marine & Fire Ins Co	10,025	2,027,114	0.05
Hyundai Mobis Co Ltd	11,033	18,697,378	0.44
Hyundai Motor Co	25,322	23,731,982	0.56
Hyundai Motor Co Ltd — 第二優先股	5,781	3,688,693	0.09
Hyundai Motor Co Ltd — 優先股	3,724	2,287,730	0.05
Hyundai Steel Co	13,063	4,779,703	0.11
Hyundai Wia Corp	2,839	1,330,367	0.03
Industrial Bank of Korea	40,335	3,288,281	0.08
Kakao Corp	4,949	2,446,196	0.06
Kangwon Land Inc	18,515	4,248,963	0.10
KB Financial Group Inc	64,979	17,852,537	0.42
KCC Corp	1,107	2,554,640	0.06
Kepco Plant Service & Engine	4,152	1,444,574	0.03
KIA Motors Corp	43,179	10,879,161	0.26
Korea Aerospace Industries	9,618	4,136,592	0.10
Korea Electric Power Corp	40,939	11,576,207	0.27
Korea Gas Corporation	5,156	1,603,577	0.04
Korea Investment Holdings Co	7,375	1,983,623	0.05
Korea Zinc Co Ltd	1,398	4,262,692	0.10
Korean Air Lines Co Ltd	6,471	1,136,088	0.03
KT Corp	1,648	311,020	0.01
KT&G Corp	19,525	12,658,889	0.30
Kumho Petrochemical Co Ltd	2,629	1,383,845	0.03
LG Chem Ltd	7,669	12,848,795	0.31
LG Chem Ltd — 優先股	1,418	1,633,894	0.04
LG Corp	15,883	6,117,401	0.14
LG Display Co Ltd	39,658	8,006,351	0.19
LG Electronics Inc	17,408	5,766,094	0.14
LG Household & Health — 優先股	296	1,069,752	0.03

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>南韓(17.12%)(續)</b>			
LG Household & Health Care	1,523	8,378,454	0.20
LG Innotek Co Ltd	2,630	1,492,420	0.04
LG Uplus Corp	35,077	2,578,167	0.06
Lotte Chemical Corp	2,528	5,988,066	0.14
Lotte Chilsung Beverage Co	95	890,348	0.02
Lotte Confectionery Co Ltd	996	1,141,250	0.03
Lotte Shopping Co	1,830	2,602,004	0.06
Mirae Asset Daewoo Co Ltd(前稱 Daewoo Securities Co Ltd)	33,084	1,537,587	0.04
Mirae Asset Securities Co Lt	10,935	1,438,983	0.03
Naver Corp	4,525	22,511,449	0.53
Ncsoft Corp	2,837	4,507,313	0.11
NH Investment & Securities C	26,091	1,616,223	0.04
OCI Co Ltd	2,943	1,486,785	0.04
Orion Corp	514	2,161,163	0.05
Ottogi Corporation	105	446,201	0.01
POSCO	11,575	19,132,926	0.45
POSCO DAEWOO Corp(前稱 Daewoo International Corp)	8,307	1,439,763	0.03
S-1 Corporation	3,632	2,044,695	0.05
Samsung Biologics Co Ltd	2,711	2,627,784	0.06
Samsung C&T Corp	12,267	9,882,464	0.23
Samsung Card Co	6,470	1,648,838	0.04
Samsung Electro-Mechanics Co	9,090	2,964,222	0.07
Samsung Electronics—優先股	2,856	26,271,662	0.62
Samsung Electronics Co Ltd	16,194	187,323,421	4.45
Samsung Fire & Marine Ins	5,362	9,241,751	0.22
Samsung Heavy Industries	41,612	2,470,834	0.06
Samsung Life Insurance Co Ltd	11,427	8,252,165	0.20
Samsung Sdi Co Ltd	9,100	6,367,238	0.15
Samsung Sds Co Ltd	5,677	5,083,657	0.12
Samsung Securities Co Ltd	10,521	2,140,915	0.05
Shinhan Financial Group Ltd	69,743	20,258,271	0.48
Shinsegae Inc	1,314	1,484,538	0.04
SK Holdings Co Ltd	7,588	11,178,748	0.27
SK Hynix Inc	95,571	27,423,117	0.65
SK Innovation Co Ltd	10,729	10,089,741	0.24
SK Networks Co Ltd	20,935	929,956	0.02
SK Telecom	3,045	4,378,431	0.10
S-Oil Corp	6,985	3,797,808	0.09
Woori Bank	48,774	3,991,919	0.09

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>南韓(17.12%)(續)</b>			
Yuhan Corp	1,270	1,626,409	0.04
		721,089,232	17.12
<b>台灣(14.46%)</b>			
宏碁股份有限公司	526,000	1,657,633	0.04
日月光半導體製造股份有限公司	1,008,294	8,016,596	0.19
研華股份有限公司	43,708	2,675,963	0.06
亞洲水泥股份有限公司	385,088	2,441,024	0.06
亞太電信有限公司	368,200	916,760	0.02
華碩電腦股份有限公司	112,784	7,189,931	0.17
友達光電股份有限公司	1,363,710	3,871,109	0.09
鎧勝控股有限公司	17,408	359,727	0.01
可成科技股份有限公司	105,200	5,668,852	0.13
國泰金融控股股份有限公司	1,334,305	15,471,539	0.37
中租控股股份有限公司	182,472	2,418,684	0.06
彰化商業銀行股份有限公司	807,430	3,331,197	0.08
正新橡膠工業股份有限公司	306,708	4,486,008	0.11
群光電子股份有限公司	88,435	1,595,573	0.04
中華航空股份有限公司	482,292	1,079,007	0.03
中華開發金融控股股份有限公司	1,972,605	3,824,781	0.09
中國人壽保險股份有限公司	601,854	4,640,348	0.11
中國鋼鐵股份有限公司	1,871,040	11,095,104	0.26
中華電信股份有限公司	618,867	15,111,053	0.36
仁寶電腦工業股份有限公司	650,841	2,888,701	0.07
中國信託金融控股股份有限公司	2,900,573	12,315,722	0.29
台達電子工業股份有限公司	311,342	11,946,199	0.28
玉山金融控股股份有限公司	1,288,807	5,689,254	0.14
儒鴻企業股份有限公司	30,360	2,464,943	0.06
長榮航空股份有限公司	368,222	1,293,284	0.03
長榮海運股份有限公司	315,600	842,736	0.02
遠東新世紀股份有限公司	581,229	3,383,717	0.08
遠傳電信股份有限公司	254,108	4,431,877	0.11
豐泰企業股份有限公司	50,394	1,460,822	0.03
第一金融控股股份有限公司	1,529,526	6,328,732	0.15
台灣化學纖維股份有限公司	526,798	12,203,988	0.29
台塑石化股份有限公司	184,898	4,981,746	0.12
台灣塑膠工業股份有限公司	676,799	14,522,986	0.34
福懋興業股份有限公司	131,500	933,209	0.02
鴻準精密工業股份有限公司	149,017	3,057,850	0.07
富邦金融控股股份有限公司	1,083,950	13,298,749	0.32
巨大機械工業股份有限公司	43,708	1,924,170	0.05

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>台灣(14.46%)(續)</b>			
興富發建設股份有限公司	114,092	1,246,070	0.03
上銀科技股份有限公司	33,863	1,205,642	0.03
鴻海精密工業股份有限公司	2,543,997	51,529,989	1.22
和泰汽車股份有限公司	43,708	3,879,883	0.09
宏達國際電子股份有限公司	109,641	2,083,682	0.05
華南金融控股股份有限公司	1,285,254	5,024,278	0.12
群創光電	1,578,103	4,403,771	0.10
英業達股份有限公司	438,208	2,329,721	0.06
大立光電股份有限公司	16,258	14,823,054	0.35
光寶科技股份有限公司	341,813	3,996,283	0.09
聯發科技股份有限公司	242,460	12,627,849	0.30
兆豐金融控股股份有限公司	1,775,744	9,825,158	0.23
美利達工業股份有限公司	43,708	1,514,101	0.04
微星科技股份有限公司	111,935	1,981,870	0.05
南亞塑膠工業股份有限公司	775,932	13,290,307	0.32
南亞科技股份有限公司	112,784	1,310,467	0.03
億豐綜合工業股份有限公司	25,005	2,000,092	0.05
聯詠科技股份有限公司	87,792	2,249,241	0.05
浩鼎生技股份有限公司	16,973	1,163,683	0.03
和碩聯合科技股份有限公司	306,708	5,681,293	0.13
群聯電子股份有限公司	17,408	1,069,969	0.03
寶成	394,500	3,815,087	0.09
力成科技股份有限公司	98,225	2,055,761	0.05
統一超商股份有限公司	87,792	4,878,635	0.12
廣達電腦股份有限公司	441,553	6,405,183	0.15
瑞昱半導體股份有限公司	87,792	2,154,202	0.05
潤泰創新國際股份有限公司	157,800	1,396,967	0.03
潤泰全球股份有限公司	87,792	1,134,124	0.03
新光金融控股股份有限公司	1,505,573	2,861,279	0.07
矽品精密工業股份有限公司	343,376	3,952,603	0.09
永豐金融控股股份有限公司	1,582,238	3,456,122	0.08
佳格食品股份有限公司	64,251	1,183,968	0.03
聯強國際股份有限公司	231,657	1,811,174	0.04
中裕新藥股份有限公司	25,005	1,001,550	0.02
台新金融控股股份有限公司	1,386,883	3,936,889	0.09
台灣中小企業銀行股份有限公司	634,801	1,244,591	0.03
台灣水泥股份有限公司	582,123	4,668,663	0.11
合作金庫金融控股股份有限公司	1,280,741	4,328,815	0.10
台灣肥料股份有限公司	131,500	1,270,114	0.03
台灣大哥大股份有限公司	263,000	6,579,918	0.16
台灣積體電路製造股份有限公司	4,033,490	176,112,011	4.18

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>台灣(14.46%)(續)</b>			
東元電機股份有限公司	350,792	2,354,427	0.06
創見資訊股份有限公司	31,356	642,675	0.02
統一企業股份有限公司	792,011	10,174,283	0.24
聯華電子股份有限公司	1,841,103	5,049,104	0.12
世界先進積體電路股份有限公司	157,800	2,133,412	0.05
緯創資通股份有限公司	401,016	2,406,931	0.06
大聯大投資控股股份有限公司	263,000	2,404,201	0.06
元大金融控股股份有限公司	1,619,279	4,674,491	0.11
裕隆汽車製造股份有限公司	157,800	1,017,356	0.02
臻鼎科技控股股份有限公司	52,600	807,305	0.02
		608,967,818	14.46
<b>泰國(2.83%)</b>			
Advanced Info Service PCL (FR)	162,058	5,157,695	0.12
Airports of Thailand PCL (FR)	69,573	5,995,033	0.14
Bangkok Bank PCL - Foreign Reg	43,623	1,506,413	0.04
Bangkok Dusit Medical Services PCL (FR)	714,459	3,573,198	0.08
Bangkok Expressway and Metro	1,132,191	1,826,181	0.04
Banpu Public Co Ltd - Foreign	198,779	826,303	0.02
BEC World PCL (FR)	179,842	646,349	0.01
Berli Jucker Public Co - NVDR	197,150	2,144,868	0.05
BTS Group Holdings PCL (FR)	1,078,302	1,996,063	0.05
Bumrungrad Hospital Pub Co - Foreign	65,750	2,576,571	0.06
C.P. All PCL (FR)	811,038	10,974,608	0.26
Central Pattana PCL (FR)	249,850	3,069,821	0.07
Charoen Pokphand Foods Co Ltd (FR)	433,528	2,768,898	0.07
Delta Electronics Thai PCL - Foreign	92,050	1,624,236	0.04
Electricity Genera PCL - NVDR	21,468	924,938	0.02
Energy Absolute PCL - Foreign	207,770	1,338,251	0.03
Glow Energy PCL (FR)	96,308	1,647,241	0.04
Home Product Center PCL (FR)	736,400	1,626,229	0.04
Indorama Ventures PCL (FR)	267,258	1,938,400	0.05
IRPC PCL - Foreign	1,849,896	1,922,456	0.04
Kasikornbank PCL	96,081	3,692,357	0.09
Kasikornbank PCL - Foreign	199,554	7,668,786	0.18
KCE Electronics - NVDR	47,296	1,249,258	0.03
Krung Thai Bank PCL (FR)	644,350	2,469,238	0.06
Minor International PCL - Foreign	315,600	2,442,760	0.06
PTT Exploration & Production PCL (FR)	225,368	4,696,354	0.11
PTT Global Chemical PCL (FR)	306,708	4,183,439	0.10
PTT PCL (FR)	162,856	13,116,396	0.31

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.75%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(90.04%)(續)</b>			
<b>泰國(2.83%)(續)</b>			
Robinson Dept Store - NVDR	82,437	1,133,349	0.03
Siam Cement PCL - NVDR	17,982	1,931,023	0.05
Siam Cement Pub Co (FR)	49,891	5,357,617	0.13
Siam Commercial Bank PCL (FR)	291,005	9,608,113	0.23
Thai Oil PCL - Foreign	148,908	2,329,291	0.05
Thai Union Group PCL - Foreign	350,792	1,594,912	0.04
TMB Bank PCL - Foreign	2,443,371	1,110,904	0.03
True Corp PCL (FR)	1,615,028	2,500,080	0.06
		119,167,629	2.83
總上市股本		3,792,475,943	90.04
<b>交易所買賣基金(9.71%)</b>			
<b>印度(9.71%)</b>			
iShares 安碩 MSCI 印度指數 ETF	7,873,881	409,017,449	9.71
交易所買賣基金總額		409,017,449	9.71
<b>非上市股本(0.00%)</b>			
<b>馬來西亞(0.00%)</b>			
RHB Capital BHD	41,075	1	0.00
非上市股本總額		1	0.00
<b>非上市供股權(0.00%)</b>			
<b>台灣(0.00%)</b>			
國泰金融控股股份有限公司－供股權	59,437	-	-
台新金融控股股份有限公司－供股權	44,191	-	-
非上市供股權總額		-	-
投資總額		4,201,493,393	99.75
其他資產淨值		10,599,080	0.25
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		4,212,092,473	100.00
投資總額(按成本)		4,274,493,030	

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
三生製藥	-	166,192	-	756	165,436
58同城-ADR	122	12,677	-	60	12,739
瑞豐科技控股有限公司	3,000	119,930	-	4,540	118,390
Aboitiz Equity Ventures Inc	8,200	344,939	-	42,868	310,271
Aboitiz Power Corp	6,200	266,934	-	1,242	271,892
宏碁股份有限公司	12,000	708,400	-	194,400	526,000
Adaro Energy TBK PT	61,200	2,633,741	-	12,240	2,682,701
Advanced Info Service PCL (FR)	3,700	159,096	-	738	162,058
日月光半導體製造股份有限公司	23,000	989,896	-	4,602	1,008,294
研華股份有限公司	1,000	42,906	-	198	43,708
中國農業銀行-H股	91,598	3,941,430	-	18,318	4,014,710
友邦保險控股有限公司	46,821	1,997,757	-	71,604	1,972,974
中國國際航空股份有限公司-H股	7,200	307,664	-	1,440	313,424
Airasia BHD	-	207,071	-	942	206,129
Airports of Thailand PCL (FR)	1,800	71,091	-	3,318	69,573
Akr Corporindo TBK PT	-	293,670	-	1,332	292,338
阿里巴巴集團控股有限公司-SP ADR	1,973	186,097	-	4,184	183,886
阿里巴巴健康信息技術有限公司	10,000	428,439	-	1,998	436,441
阿里巴巴影業集團有限公司	40,000	1,720,670	-	7,998	1,752,672
Alliance Financial Group BHD	4,600	197,826	-	918	201,508
Alliance Global Group Inc	8,600	370,214	-	1,722	377,092
中國鋁業股份有限公司-H股	16,000	688,268	-	3,198	701,070
AMMB Holdings BHD	8,300	307,344	-	24,526	291,118
Amorepacific Corp	128	5,281	-	150	5,259
Amorepacific Corp-優先股	38	1,594	-	6	1,626
Amorepacific Group	94	4,686	-	24	4,756
安徽海螺水泥股份有限公司-H股	5,000	213,269	-	16,002	202,267
安踏體育用品有限公司	4,000	171,967	-	798	175,169
Ascendas Real Estate Inv Trt	8,600	830,055	-	461,584	377,071
亞洲水泥股份有限公司	10,000	425,086	-	49,998	385,088
亞太電信有限公司	8,400	361,480	-	1,680	368,200
Asm Pacific Technology	1,000	42,867	-	198	43,669
Astra Agro Lestari TBK PT	1,680	21,840	-	23,520	-
Astra International TBK PT	80,698	3,317,756	-	87,408	3,311,046
Astro Malaysia Holdings BHD	6,600	284,020	-	1,320	289,300
華碩電腦股份有限公司	3,000	116,300	-	6,516	112,784
友達光電股份有限公司	36,000	1,514,910	-	187,200	1,363,710
中國航空科技工業-H股	8,000	344,233	-	1,602	350,631
Axiata Group Berhad	10,800	464,760	-	2,160	473,400
Ayala Corporation	910	39,033	-	180	39,763
Ayala Land Inc	24,900	1,202,201	-	5,574	1,221,527

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
百度股份有限公司—SPON ADR	554	45,106	-	954	44,706
Bangkok Bank PCL - Foreign Reg	1,000	42,821	-	198	43,623
Bangkok Dusit Medical Services PCL (FR)	16,300	701,417	-	3,258	714,459
Bangkok Expressway And Metro	-	1,137,357	-	5,166	1,132,191
Bank Central Asia TBK PT	49,140	2,020,747	-	53,104	2,016,783
Bank Cimb Niaga TBK PT	-	29,622	-	29,622	-
Bank Danamon Indonesia TBK	14,100	606,770	-	2,820	618,050
Bank Mandiri Persero TBK PT	35,700	1,536,393	-	7,140	1,564,953
Bank Negara Indonesia Perser	31,400	1,359,492	-	150,758	1,240,134
中國銀行股份有限公司—H股	308,750	13,220,324	-	461,930	13,067,144
交通銀行股份有限公司—H股	33,400	1,436,910	-	6,678	1,463,632
東亞銀行	5,000	199,507	-	10,882	193,625
Bank of The Philippine Islan	3,310	115,585	-	27,984	90,911
Bank Rakyat Indonesia Perser	43,100	1,841,153	-	80,022	1,804,231
Banpu Public Co Ltd - Foreign	4,380	195,305	-	906	198,779
BDO Unibank Inc	6,790	285,950	-	33,726	259,014
BEC World PCL (FR)	4,100	176,564	-	822	179,842
北京首都國際機場—H股	6,000	257,472	-	1,200	262,272
北京控股有限公司	2,000	86,133	-	402	87,731
北控水務集團有限公司	18,000	755,148	-	103,600	669,548
百麗國際控股有限公司	20,000	1,031,323	-	4,776	1,046,547
Berjaya Sports Toto BHD	2,839	122,241	-	570	124,510
Berli Jucker Public Co - NVDR	-	197,150	-	-	197,150
BGF Retail Co Ltd	36	1,704	1,312	6	3,046
BNK Financial Group Inc	905	47,123	-	5,392	42,636
中國銀行(香港)有限公司	14,734	605,978	-	15,760	604,952
華晨中國汽車控股有限公司	12,000	515,072	-	2,400	524,672
British American Tobacco BHD	500	21,644	-	102	22,042
BTS Group Holdings PCL (FR)	24,600	1,058,622	-	4,920	1,078,302
Bumi Armada Berhad	9,900	128,700	-	138,600	-
Bumi Serpong Damai PT	30,900	1,329,732	-	6,180	1,354,452
Bumrungrad Hospital Pub Co - Foreign	1,500	64,550	-	300	65,750
比亞迪股份有限公司—H股	2,500	107,067	-	498	109,069
C.P. All PCL (FR)	18,500	796,240	-	3,702	811,038
Capitaland Commercial Trust	8,700	374,320	-	1,740	381,280
Capitaland Ltd	8,800	455,887	-	38,448	426,239
Capitaland Mall Trust	10,200	430,044	-	48,140	392,104
神州租車有限公司	3,000	39,000	-	42,000	-
鎢勝控股有限公司	400	17,086	-	78	17,408
可成科技股份有限公司	2,400	103,280	-	480	105,200
國泰金融控股股份有限公司	32,650	1,338,745	-	37,090	1,334,305

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
國泰航空有限公司	5,000	214,305	-	1,002	218,303
Celltrion Inc	269	13,118	634	692	13,329
Central Pattana PCL (FR)	5,700	245,290	-	1,140	249,850
中國廣核電力股份有限公司-H股	37,600	1,617,030	-	7,518	1,647,112
中租控股股份有限公司	4,160	179,146	-	834	182,472
彰化商業銀行股份有限公司	19,260	849,300	21,956	83,086	807,430
Charoen Pokphand Foods Co Ltd (FR)	13,000	466,108	-	45,580	433,528
Charoen Pokphand Indonesi PT	31,100	1,338,466	-	6,222	1,363,344
Cheil Worldwide Inc	339	14,248	-	3,233	11,354
正新橡膠工業股份有限公司	7,000	301,106	-	1,398	306,708
長江基建集團有限公司	2,400	102,512	-	480	104,432
長江實業地產有限公司	10,416	438,066	-	6,516	441,966
群光電子股份有限公司	2,010	86,647	180	402	88,435
中華航空股份有限公司	11,000	473,494	-	2,202	482,292
中國信達資產管理股份有限公司-H股	37,000	1,559,542	-	173,398	1,423,144
中信銀行股份有限公司-H股	34,000	1,463,070	-	6,798	1,490,272
中國中煤能源股份有限公司-H股	11,000	335,275	-	141,936	204,339
中國交通建設股份有限公司-H股	17,200	739,584	-	3,438	753,346
中國通信服務股份有限公司-H股	10,000	428,439	-	1,998	436,441
中國海螺創業控股有限公司	5,700	242,332	-	26,140	221,892
中國建設銀行-H股	327,329	13,810,943	-	435,600	13,702,672
中華開發金融控股股份有限公司	45,000	1,936,605	-	9,000	1,972,605
中國光大銀行股份有限公司-H股	14,000	591,337	-	98,802	506,535
中國光大國際有限公司	10,000	429,567	-	1,998	437,569
中國光大控股有限公司	4,000	168,791	-	20,798	151,993
中國恒大集團(前稱恒大地產集團)	15,800	679,185	-	3,162	691,823
中國銀河證券股份有限公司-H股	14,000	505,613	-	47,160	472,453
中國燃氣控股有限公司	4,000	295,289	-	25,260	274,029
中國華融資產管理-H股	-	825,384	-	-	825,384
中國輝山乳業控股有限公司	27,000	516,200	-	17,400	525,800
中國國際海運-H股	2,100	27,300	-	29,400	-
中國金茂控股集團有限公司	14,000	601,705	-	2,802	612,903
中國人壽保險股份有限公司-H股	28,872	1,212,316	-	19,574	1,221,614
中國人壽保險股份有限公司	13,200	581,898	9,504	2,748	601,854
龍源電力集團股份有限公司-H股	13,000	558,468	-	2,598	568,870
康哲藥業控股有限公司	5,000	214,305	-	1,002	218,303
中國蒙牛乳業有限公司	10,800	461,576	-	23,160	449,216
招商銀行-H股	18,300	667,396	-	58,862	626,834
招商局港口控股有限公司(前稱招商局國際有限公司)	5,200	223,287	-	1,038	227,449

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
中國民生銀行—H股	22,600	972,024	-	4,518	990,106
中國移動有限公司	24,198	1,019,938	-	38,144	1,005,992
中國建材股份有限公司—H股	12,000	515,072	-	2,400	524,672
中海油田服務股份有限公司—H股	8,000	338,985	-	49,602	297,383
中國海外發展有限公司	14,330	652,864	-	26,922	640,272
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—H股	10,480	431,975	-	10,768	431,687
中國石油化工股份有限公司—H股	101,516	4,178,276	-	107,044	4,172,748
中國電力國際發展有限公司	13,000	558,468	-	2,598	568,870
中國鐵建股份有限公司—H股	8,500	360,103	-	42,988	325,615
中國中鐵股份有限公司—H股	17,000	664,097	-	33,958	647,139
華潤啤酒(控股)有限公司	4,800	267,758	-	1,242	271,316
華潤燃氣控股有限公司	4,000	145,563	-	12,630	136,933
華潤置地有限公司	10,800	462,624	-	2,160	471,264
華潤電力控股有限公司	8,044	346,337	-	33,464	320,917
中國神華能源股份有限公司—H股	14,500	553,965	-	5,568	562,897
中國南方航空股份有限公司—H股	8,000	344,233	-	1,602	350,631
中國建築國際集團有限公司	6,000	257,472	-	1,200	262,272
中國鋼鐵股份有限公司	42,683	1,836,895	-	8,538	1,871,040
中國太平保險控股有限公司	6,800	289,515	-	29,018	267,297
中國電信股份有限公司—H股	58,000	2,151,309	-	18,002	2,191,307
中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司	23,600	1,003,483	-	62,722	964,361
萬科企業股份有限公司—H股	5,500	232,307	-	23,498	214,309
重慶長安汽車股份有限公司—B股	3,600	133,700	-	690	136,610
重慶農村商業銀行—H股	11,000	466,121	-	65,202	411,919
中華電信股份有限公司	15,400	624,293	-	20,826	618,867
Cimb Group Holdings BHD	18,200	552,149	-	109,800	460,549
中國中信股份有限公司	17,400	741,028	-	43,480	714,948
中信證券股份有限公司—H股	9,000	359,048	-	14,614	353,434
城市發展有限公司	1,700	73,253	-	342	74,611
CJ Cheiljedang Corp	33	1,392	-	130	1,295
CJ Corp	61	2,582	-	12	2,631
CJ E&M Corp	62	2,683	-	12	2,733
CJ Korea Express Corp	29	1,291	-	6	1,314
長江和記實業有限公司	10,316	447,001	-	12,570	444,747
中電控股有限公司	7,587	292,085	-	29,766	269,906
中國海洋石油有限公司	71,266	2,919,097	-	67,338	2,923,025
康福德高企業有限公司	9,000	356,712	-	15,796	349,916
仁寶電腦工業股份有限公司	18,000	1,076,441	-	443,600	650,841
中遠海運發展股份有限公司—H股(前稱中海集裝箱運輸股份有限公司—H股)	16,000	576,044	-	592,044	-

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
中遠海運控股股份有限公司—H股(前稱中國遠洋 控股股份有限公司—H股)	11,000	396,057	-	407,057	-
中遠海運港口有限公司(前稱中遠太平洋有限公司)	8,000	283,613	-	29,200	262,413
碧桂園控股有限公司	24,000	1,011,010	-	105,800	929,210
Coway Co Ltd	185	7,948	-	36	8,097
中國中車股份有限公司—H股	18,000	694,626	-	40,072	672,554
石藥集團有限公司	18,000	601,705	-	6,802	612,903
中國信託金融控股股份有限公司	55,697	2,688,192	169,920	13,236	2,900,573
攜程旅行網—ADR	474	61,786	-	282	61,978
Daelim Industrial Co Ltd	117	5,063	-	24	5,156
Daewoo Engineering & Constr	443	19,163	-	90	19,516
大連萬達商業地產股份有限公司—H股	2,500	60,517	-	63,017	-
大唐國際發電股份有限公司—H股	12,000	156,000	-	168,000	-
星辰集團控股有限公司	7,020	298,551	-	14,162	291,409
台達電子工業股份有限公司	7,100	305,664	-	1,422	311,342
Delta Electronics Thai PCL - Foreign	2,100	90,370	-	420	92,050
DGB Financial Group Inc	712	30,681	-	144	31,249
Dialog Group BHD	15,700	544,824	-	63,268	497,256
Digi.Com BHD	14,700	580,985	-	26,698	568,987
DMCI Holdings Inc	16,800	722,960	-	3,360	736,400
Dongbu Insurance Co Ltd	175	7,544	-	36	7,683
東風汽車集團股份有限公司—H股	12,000	458,458	-	33,998	436,460
Dongsuh Companies Inc	147	6,354	-	30	6,471
Doosan Corp	31	390	-	421	-
Doosan Heavy Industries	203	8,835	-	42	8,996
玉山金融控股股份有限公司	29,348	1,319,087	52,828	112,456	1,288,807
儒鴻企業股份有限公司	400	30,098	-	138	30,360
Electricity Genera PCL - NVDR	-	21,564	-	96	21,468
E-Mart Inc	88	3,181	-	224	3,045
Energy Absolute PCL - Foreign	4,740	203,978	-	948	207,770
Energy Development Corp	39,500	1,699,946	-	7,902	1,731,544
新奧能源控股有限公司	2,800	118,519	-	558	120,761
長榮航空股份有限公司	8,000	353,101	8,801	1,680	368,222
長榮海運股份有限公司	7,200	309,840	-	1,440	315,600
房天下控股有限公司—ADR	-	39,272	-	39,272	-
遠東宏信有限公司	7,000	300,767	-	1,398	306,369
遠東新世紀股份有限公司	13,259	570,622	-	2,652	581,229
遠傳電信股份有限公司	5,800	342,251	-	93,943	254,108
Felda Global Ventures	5,400	232,380	-	1,080	236,700

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
豐泰企業股份有限公司	1,029	47,371	2,222	228	50,394
第一金融控股股份有限公司	37,031	1,610,239	29,996	147,740	1,529,526
第一太平有限公司	10,000	415,511	-	69,998	355,513
台灣化學纖維股份有限公司	12,800	527,404	-	13,406	526,798
台塑石化股份有限公司	5,000	191,744	-	11,846	184,898
台灣塑膠工業股份有限公司	16,150	673,739	-	13,090	676,799
福懋興業股份有限公司	3,000	129,100	-	600	131,500
復星國際有限公司	8,897	382,872	-	1,782	389,987
鴻準精密工業股份有限公司	4,040	169,891	902	25,816	149,017
富邦金融控股股份有限公司	26,800	1,091,094	-	33,944	1,083,950
豐盛控股有限公司	-	1,121,684	-	-	1,121,684
福耀玻璃工業集團股份有限公司-H股	-	78,880	-	-	78,880
銀河娛樂集團有限公司	9,400	384,981	-	10,752	383,629
Gamuda BHD	6,900	296,930	-	1,380	302,450
保利協鑫能源控股有限公司	46,000	1,979,272	-	9,198	2,016,074
吉利汽車控股有限公司	20,000	860,301	-	4,002	876,299
Genting BHD	9,500	373,805	-	18,068	365,237
Genting Malaysia BHD	12,500	524,540	-	72,902	464,138
Genting Plantations BHD	960	41,312	-	192	42,080
Genting Singapore Plc	25,500	1,075,974	-	116,900	984,574
廣發證券股份有限公司-H股	4,000	233,640	-	1,080	236,560
巨大機械工業股份有限公司	1,000	42,906	-	198	43,708
Global Logistic Properties L	13,200	462,552	-	51,138	424,614
Global Mediacom TBK PT	30,180	1,086,482	-	1,116,662	-
Globe Telecom Inc	140	6,152	-	30	6,262
Glow Energy PCL (FR)	2,200	94,546	-	438	96,308
金光農業資源有限公司	29,700	1,278,022	-	5,940	1,301,782
金銀地產控股有限公司	6,000	-	-	6,000	-
國美電器控股有限公司	50,400	2,168,545	-	10,080	2,208,865
長城汽車股份有限公司-H股	10,500	451,800	-	2,100	460,200
GS Engineering & Construct	209	9,037	-	42	9,204
GS Holdings	215	9,111	-	1,005	8,321
GS Retail Co Ltd	88	3,772	-	18	3,842
GT Capital Holdings Inc	330	14,201	-	66	14,465
粵海投資有限公司	12,000	468,288	-	24,088	456,200
廣州汽車集團股份有限公司-H股	10,000	360,147	-	33,542	336,605
廣州富力地產股份有限公司-H股	4,400	185,817	-	32,482	157,735
Gudang Garam TBK PT	2,000	85,298	-	8,502	78,796
海爾電器集團有限公司	5,000	214,305	-	1,002	218,303
海天國際控股有限公司	3,000	121,576	-	36,600	87,976
海通證券股份有限公司-H股	13,600	516,536	-	34,262	495,874

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Hana Financial Group	921	50,177	-	2,537	48,561
恒隆集團有限公司	-	145,080	-	-	145,080
恒隆地產有限公司	9,000	380,560	-	34,800	354,760
恒生銀行有限公司	3,037	125,164	-	3,070	125,131
Hankook Tire Co Ltd	313	13,087	-	1,133	12,267
Hanmi Pharm Co Ltd	17	887	-	6	898
Hanmi Science Co Ltd	48	2,178	-	12	2,214
Hanon Systems	157	33,768	628	156	34,397
Hanssem Co Ltd	40	1,594	-	6	1,628
Hanwha Chemical Corp	443	19,163	-	90	19,516
Hanwha Corporation	189	8,049	-	36	8,202
Hanwha Life Insurance Co Ltd	914	39,516	-	180	40,250
Hanwha Techwin Co Ltd	-	6,202	-	-	6,202
Hap Seng Consolidated	-	92,980	-	420	92,560
Hartalega Holdings BHD	-	108,444	-	492	107,952
恒基兆業地產有限公司	4,400	178,767	5,161	10,810	177,518
恒安國際集團有限公司	3,000	163,360	-	47,970	118,390
恒騰網絡集團有限公司	-	3,638,176	-	-	3,638,176
漢民微測科技股份有限公司	-	5,326	-	5,326	-
興富發建設股份有限公司	2,600	112,014	-	522	114,092
上銀科技股份有限公司	1,029	43,592	452	11,210	33,863
港燈電力投資有限公司—SS 股	8,700	374,320	-	1,740	381,280
香港電訊信託與香港電訊有限公司—SS 股	11,000	438,759	-	17,974	431,785
Hm Sampoerna TBK PT	1,380	1,054,092	463,680	6,900	1,512,252
Home Product Center PCL (FR)	16,800	722,960	-	3,360	736,400
鴻海精密工業股份有限公司	55,668	2,448,862	119,209	79,742	2,543,997
香港中華煤氣	27,568	1,214,010	36,298	28,706	1,249,170
香港交易及結算所有限公司	4,391	187,757	-	3,770	188,378
Hong Leong Bank Berhad	1,940	83,612	-	390	85,162
Hong Leong Financial Group	981	42,300	-	198	43,083
香港置地有限公司	2,400	191,908	-	882	193,426
和泰汽車股份有限公司	1,000	42,906	-	198	43,708
Hotel Shilla Co Ltd	138	6,051	-	30	6,159
宏達國際電子股份有限公司	3,000	125,241	-	18,600	109,641
華南金融控股股份有限公司	27,610	1,229,267	34,239	5,862	1,285,254
華電國際電力股份有限公司—H 股	6,000	216,000	-	222,000	-
華能國際電力股份有限公司—H 股	14,000	601,705	-	2,802	612,903
華能新能源股份有限公司—H 股	16,000	688,268	-	3,198	701,070
華泰證券股份有限公司—H 股	3,600	249,088	-	60,400	192,288
和記港口集團有限公司—U 股	23,800	886,104	-	68,240	841,664
Hyosung Corporation	95	3,703	-	276	3,522

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
希慎興業有限公司	2,400	102,512	-	480	104,432
Hyundai Dept Store Co	64	2,683	-	12	2,735
Hyundai Development Co-Engin	148	7,982	-	36	8,094
Hyundai Engineering & Const	323	11,972	-	2,222	10,073
Hyundai Glovis Co Ltd	79	3,341	-	393	3,027
Hyundai Heavy Industries	176	6,930	-	338	6,768
Hyundai Marine & Fire Ins Co	150	9,923	-	48	10,025
Hyundai Mobis Co Ltd	271	11,028	-	266	11,033
Hyundai Motor Co	614	26,534	-	1,826	25,322
Hyundai Motor Co Ltd - 第二優先股	158	6,547	-	924	5,781
Hyundai Motor Co Ltd - 優先股	100	4,176	-	552	3,724
Hyundai Steel Co	337	14,192	-	1,466	13,063
Hyundai Wia Corp	67	2,784	-	12	2,839
IHH Healthcare BHD	10,300	541,450	-	2,508	549,242
IJM Corp BHD	12,800	483,509	-	33,512	462,797
中國工商銀行—H股	286,164	12,146,063	-	314,932	12,117,295
Indocement Tunggal Prakarsa	6,200	266,934	-	1,242	271,892
Indofood Cbp Sukses Makmur T	4,900	338,470	88,183	1,962	429,591
Indofood Sukses Makmur TBK P	18,500	776,195	-	108,502	686,193
Indorama Ventures PCL (FR)	6,100	262,376	-	1,218	267,258
Industrial Bank of Korea	1,172	42,932	-	3,769	40,335
群創光電	36,000	1,549,303	-	7,200	1,578,103
華亞科技股份有限公司	10,000	359,943	-	369,943	-
Intl Container Term Svcs Inc	2,140	91,964	-	426	93,678
英業達股份有限公司	10,000	430,206	-	1,998	438,208
IOI Corp BHD	12,200	402,604	-	58,726	356,078
IOI Properties Group BHD	6,420	276,274	-	1,284	281,410
IRPC PCL - Foreign	42,200	1,816,138	-	8,442	1,849,896
怡和合發有限公司	500	17,167	-	2,072	15,595
怡和控股有限公司	-	40,988	-	186	40,802
Jasa Marga (Persero) TBK PT	8,700	398,251	-	1,740	405,211
京東商城電子商務有限公司—ADR	687	112,513	-	3,135	110,065
JG Summit Holdings Inc	10,560	454,432	-	2,112	462,880
江蘇寧滬高速公路股份有限公司—H股	2,000	198,597	-	912	199,685
江西銅業股份有限公司—H股	6,000	248,924	-	48,942	205,982
Jollibee Foods Corp	1,800	77,460	-	360	78,900
Kakao Corp	112	4,861	-	24	4,949
Kalbe Farma TBK PT	88,798	3,778,843	-	413,660	3,453,981
Kangwon Land Inc	424	18,175	-	84	18,515
Kasikornbank PCL	2,280	96,519	-	2,718	96,081
Kasikornbank PCL - Foreign	4,100	196,366	-	912	199,554

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
KB Financial Group Inc	1,513	64,697	-	1,231	64,979
KCC Corp	24	1,089	-	6	1,107
KCE Electronics - NVDR	-	47,296	-	-	47,296
Kepeco Plant Service & Engine	95	4,075	-	18	4,152
吉寶企業有限公司	5,135	252,845	-	16,188	241,792
嘉里建設有限公司	2,500	107,067	-	498	109,069
KIA Motors Corp	1,051	43,259	-	1,131	43,179
金山軟件有限公司	2,000	138,693	-	16,570	124,123
Korea Aerospace Industries	185	9,475	-	42	9,618
Korea Electric Power Corp	945	41,795	-	1,801	40,939
Korea Gas Corporation	117	5,063	-	24	5,156
Korea Investment Holdings Co	164	7,241	-	30	7,375
Korea Zinc Co Ltd	36	1,431	-	69	1,398
Korean Air Lines Co Ltd	147	6,354	-	30	6,471
Krung Thai Bank PCL (FR)	14,700	632,590	-	2,940	644,350
KT Corp	134	1,514	-	-	1,648
KT&G Corp	438	19,177	-	90	19,525
Kuala Lumpur Kepong BHD	1,800	76,564	-	8,460	69,904
Kumho Petrochemical Co Ltd	59	2,582	-	12	2,629
昆侖能源有限公司	14,000	582,441	-	98,802	497,639
Lafarge Malaysia BHD	1,620	69,714	-	324	71,010
大立光電股份有限公司	424	18,912	-	3,078	16,258
聯想集團有限公司	28,000	1,203,342	-	5,598	1,225,744
LG Chem Ltd	185	7,700	-	216	7,669
LG Chem Ltd – 優先股	32	1,392	-	6	1,418
LG Corp	362	15,593	-	72	15,883
LG Display Co Ltd	670	39,168	-	180	39,658
LG Electronics Inc	400	17,086	-	78	17,408
LG Household & Health – 優先股	-	296	-	-	296
LG Household & Health Care	36	1,493	-	6	1,523
LG Innotek Co Ltd	60	2,582	-	12	2,630
LG Uplus Corp	901	38,346	-	4,170	35,077
利豐有限公司	24,000	1,032,402	-	4,800	1,051,602
領展房地產投資信託基金	8,900	367,753	-	8,680	367,973
Lippo Karawaci TBK PT	82,600	3,554,634	-	16,524	3,620,710
光寶科技股份有限公司	9,045	351,477	851	19,560	341,813
龍湖地產	6,000	258,100	-	1,200	262,900
Lotte Chemical Corp	65	2,598	-	135	2,528
Lotte Chilsung Beverage Co	1	94	-	-	95
Lotte Confectionery Co Ltd	3	1,105	27	139	996
Lotte Shopping Co	46	1,796	-	12	1,830

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
	<b>上市股本(續)</b>				
綠葉製藥集團有限公司	5,500	197,943	-	203,443	-
Malayan Banking BHD	17,500	598,862	-	74,372	541,990
Malaysia Airports Hldgs BHD	3,500	147,672	-	28,902	122,270
Matahari Department Store TB	9,800	418,684	-	40,370	388,114
Maxis BHD	7,900	336,124	-	36,578	307,446
Media Nusantara Citra TBK PT	21,240	914,024	-	4,248	931,016
聯發科技股份有限公司	6,105	245,459	-	9,104	242,460
兆豐金融控股股份有限公司	44,083	1,789,761	-	58,100	1,775,744
Megaworld Corp	48,000	2,065,705	-	9,600	2,104,105
新濠博亞娛樂有限公司-ADR	314	31,189	-	144	31,359
美利達工業股份有限公司	1,000	42,906	-	198	43,708
Metro Pacific Investments Co	56,000	2,409,994	-	11,202	2,454,792
Metropolitan Bank & Trust	1,356	104,742	-	480	105,618
美高梅(中國)控股有限公司	4,000	171,767	-	798	174,969
微星科技股份有限公司	-	111,935	-	-	111,935
Minor International PCL - Foreign	7,200	309,840	-	1,440	315,600
Mirae Asset Daewoo Co Ltd (前稱 Daewoo Securities Co Ltd)	757	32,477	-	150	33,084
Mirae Asset Securities Co Lt	251	10,732	-	48	10,935
MISC BHD	4,700	202,384	-	942	206,142
香港鐵路有限公司	6,000	241,944	-	8,592	239,352
南亞塑膠工業股份有限公司	19,057	779,415	-	22,540	775,932
南亞科技股份有限公司	-	113,300	-	516	112,784
Naver Corp	107	4,601	-	183	4,525
Ncsoft Corp	65	2,784	-	12	2,837
網易公司-ADR	156	12,942	-	60	13,038
新華人壽保險股份有限公司-H股	3,300	139,252	-	13,660	128,892
新東方教育科技集團-SP ADR	219	21,905	-	102	22,022
新世界中國地產有限公司	10,000	-	-	10,000	-
新世界發展有限公司	19,493	974,560	-	41,398	952,655
NH Investment & Securities C	593	25,618	-	120	26,091
億豐綜合工業股份有限公司	-	25,119	-	114	25,005
玖龍紙業(控股)有限公司	7,000	300,767	-	1,398	306,369
Noble Group Ltd	19,900	1,452,860	-	1,472,760	-
聯詠科技股份有限公司	2,000	86,194	-	402	87,792
新創建集團有限公司	6,321	275,266	-	24,266	257,321
浩鼎生科技股份有限公司	600	19,451	-	3,078	16,973
OCI Co Ltd	70	2,885	-	12	2,943
Orion Corp	15	505	-	6	514
Ottogi Corporation	4	101	-	-	105
華僑銀行有限公司	12,312	524,030	-	26,600	509,742

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Pakuwon Jati TBK PT	-	3,969,098	-	-	3,969,098
Paradise Co Ltd	194	7,055	-	7,249	-
PCCW Ltd	17,000	731,629	-	3,402	745,227
和碩聯合科技股份有限公司	7,000	301,106	-	1,398	306,708
中國人民保險集團股份有限公司—H股	28,000	1,204,470	-	5,598	1,226,872
Perusahaan Gas Negara Perser	45,900	1,953,319	-	213,080	1,786,139
中國石油天然氣股份有限公司—H股	83,585	3,449,215	-	83,744	3,449,056
Petronas Chemicals Group BHD	11,800	415,617	-	44,746	382,671
Petronas Dagangan BHD	1,000	40,374	-	13,398	27,976
Petronas Gas BHD	2,900	115,013	-	5,116	112,797
群聯電子股份有限公司	400	17,086	-	78	17,408
中國人民財產保險股份有限公司—H股	14,000	745,183	-	3,456	755,727
中國平安保險(集團)股份有限公司—H股	20,896	853,822	-	16,478	858,240
PLDT Inc(前稱 Philippine Long Distance Tel)	410	16,155	-	777	15,788
POSCO	273	11,472	-	170	11,575
POSCO DAEWOO Corp(前稱 Daewoo International Corp)	193	8,150	-	36	8,307
寶成	9,000	387,300	-	1,800	394,500
電能實業有限公司	5,460	225,986	-	5,032	226,414
力成科技股份有限公司	3,000	171,825	-	76,600	98,225
PPB Group Berhad	2,000	86,194	-	402	87,792
統一超商股份有限公司	2,000	86,194	-	402	87,792
PTT Exploration & Production PCL (FR)	5,900	231,094	-	11,626	225,368
PTT Global Chemical PCL (FR)	7,000	301,106	-	1,398	306,708
PTT PCL (FR)	4,200	166,200	-	7,544	162,856
Public Bank Berhad	10,060	432,788	-	2,010	440,838
奇虎360 科技有限公司—ADR	155	5,992	-	6,147	-
親親食品集團(開曼)股份有限公司	-	8,686	-	8,686	-
廣達電腦股份有限公司	11,000	445,569	-	15,016	441,553
Qunar Cayman Islands Ltd—ADR	-	5,785	-	24	5,761
瑞儀光電股份有限公司	2,000	26,013	-	28,013	-
瑞昱半導體股份有限公司	2,000	130,882	-	45,090	87,792
RHB Bank BHD	-	147,538	-	672	146,866
Robinson Dept Store—NVDR	-	82,815	-	378	82,437
Robinsons Land Co	-	270,805	-	1,230	269,575
潤泰創新國際股份有限公司	3,600	154,920	-	720	157,800
潤泰全球股份有限公司	2,000	124,212	-	38,420	87,792
S-1 Corporation	80	3,570	-	18	3,632
Samsung Biologics Co Ltd	-	2,711	-	-	2,711
Samsung C&T Corp	302	12,296	-	331	12,267

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Samsung Card Co	146	6,354	-	30	6,470
Samsung Electro-Mechanics Co	252	9,521	-	683	9,090
Samsung Electronics – 優先股	79	3,083	-	306	2,856
Samsung Electronics Co Ltd	433	16,992	-	1,231	16,194
Samsung Fire & Marine Ins	142	5,499	-	279	5,362
Samsung Heavy Industries	632	41,106	-	126	41,612
Samsung Life Insurance Co Ltd	305	11,839	-	717	11,427
Samsung Sdi Co Ltd	206	8,936	-	42	9,100
Samsung Sds Co Ltd	118	5,583	-	24	5,677
Samsung Securities Co Ltd	241	10,328	-	48	10,521
金沙中國有限公司	9,430	402,879	-	15,084	397,225
Saparakencana Petroleum BHD	13,900	598,137	-	2,778	609,259
Sats Ltd	-	111,052	-	-	111,052
Security Bank Corp	-	47,648	-	28,030	19,618
勝科工業	4,100	176,493	-	822	179,771
Sembcorp Marine Ltd	3,500	126,057	-	129,557	-
Semen Indonesia Persero TBK	12,500	531,900	-	58,802	485,598
中芯國際集成電路製造有限公司	111,998	5,154,793	-	4,839,925	426,866
山東威高集團醫用高分子製品股份有限公司—H股	8,000	341,977	-	1,602	348,375
上海電氣集團總公司—H股	12,000	515,072	-	2,400	524,672
上海復星醫藥(集團)股份有限公司—H股	1,500	64,400	-	300	65,600
上海實業控股有限公司	2,000	85,505	-	402	87,103
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司—B股	2,000	95,600	22,400	690	119,310
上海醫藥集團股份有限公司—H股	2,900	124,873	-	582	127,191
香格里拉(亞洲)有限公司	6,000	247,456	-	53,200	200,256
申洲國際集團	2,000	85,505	-	402	87,103
世茂房地產控股有限公司	6,000	210,688	-	22,888	193,800
新光金融控股股份有限公司	34,347	1,478,096	-	6,870	1,505,573
Shinhan Financial Group Ltd	1,702	71,225	-	3,184	69,743
Shinsegae Inc	29	1,291	-	6	1,314
瑞安房地產有限公司	15,000	540,000	-	555,000	-
Siam Cement PCL—NVDR	-	18,066	-	84	17,982
Siam Cement Pub Co (FR)	1,140	48,979	-	228	49,891
Siam Commercial Bank PCL (FR)	6,600	296,863	-	12,458	291,005
矽品精密工業股份有限公司	9,112	510,643	-	176,379	343,376
Sime Darby Berhad	11,900	430,442	-	61,554	380,788
新普科技股份有限公司	1,200	43,200	-	44,400	-
新浪公司	-	9,324	-	-	9,324
新加坡航空公司	2,300	90,033	-	4,602	87,731
新加坡交易所有限公司	2,700	129,566	-	11,012	121,254

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Singapore Press Holdings Ltd	-	11,800	-	-	11,800
Singapore Tech Engineering	6,600	278,748	-	25,920	259,428
新加坡電信	31,766	1,333,285	-	40,642	1,324,409
中國生物製藥有限公司	18,000	773,668	-	3,600	788,068
信和置業有限公司	12,000	515,072	-	2,400	524,672
遠洋集團控股有限公司(前稱遠洋地產控有限公司)	14,000	542,353	-	316,802	239,551
永豐金融控股股份有限公司	40,795	1,759,254	38,757	256,568	1,582,238
中石化煉化工程(集團)股份有限公司-H股	5,000	214,805	-	1,002	218,803
中國石化上海石油化工股份有限公司-H股	14,000	601,705	-	2,802	612,903
國藥控股股份有限公司-H股	4,720	201,735	-	10,942	195,513
中國外運股份有限公司-H股	8,000	344,233	-	1,602	350,631
SJM Holdings Ltd	8,000	344,233	-	1,602	350,631
SK Holdings Co Ltd	140	7,484	-	36	7,588
SK Hynix Inc	2,282	95,204	-	1,915	95,571
SK Innovation Co Ltd	247	10,530	-	48	10,729
SK Networks Co Ltd	476	20,555	-	96	20,935
SK Telecom	41	3,016	-	12	3,045
SM Investments Corp	670	36,552	6,021	5,338	37,905
SM Prime Holdings Inc	34,900	1,377,439	-	64,150	1,348,189
Soho 中國有限公司	9,000	386,900	-	1,800	394,100
S-Oil Corp	190	7,838	-	1,043	6,985
佳格食品股份有限公司	1,320	60,321	2,904	294	64,251
Starhub Ltd	2,500	107,367	-	498	109,369
Summarecon Agung TBK PT	42,500	1,829,048	-	8,502	1,863,046
高鑫零售有限公司	10,000	425,459	-	44,998	390,461
新鴻基地產發展有限公司	7,088	262,851	-	32,116	237,823
融創中國控股有限公司	8,000	344,233	-	1,602	350,631
舜宇光學科技(集團)有限公司	-	117,392	-	-	117,392
Suntec Reit	10,000	974,785	-	546,616	438,169
Surya Citra Media PT TBK	24,600	1,058,622	-	4,920	1,078,302
太古股份有限公司-CL A股	2,200	93,347	-	6,438	89,109
太古地產有限公司	5,000	194,791	-	10,264	189,527
聯強國際股份有限公司	6,000	260,317	6,600	41,260	231,657
中裕新藥股份有限公司	-	25,119	-	114	25,005
台新金融控股股份有限公司	34,000	1,375,247	46,966	69,330	1,386,883
台灣中小企業銀行股份有限公司	18,242	785,016	20,371	188,828	634,801
台灣水泥股份有限公司	14,000	591,925	-	53,802	552,123
合作金庫金融控股股份有限公司	30,448	1,338,311	40,498	128,516	1,280,741
台灣肥料股份有限公司	3,000	129,100	-	600	131,500

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
	<b>上市股本(續)</b>				
台灣大哥大股份有限公司	6,000	258,200	-	1,200	263,000
台灣積體電路製造股份有限公司	95,705	4,071,535	-	133,750	4,033,490
好未來教育集團-ADR	-	6,906	-	30	6,876
創科實業有限公司	5,400	231,940	-	1,080	236,260
東元電機股份有限公司	8,000	344,394	-	1,602	350,792
Telekom Malaysia BHD	4,700	202,384	-	942	206,142
Telekomunikasi Indonesia Per	200,858	8,260,509	-	216,420	8,244,947
Tenaga Nasional BHD	13,520	555,218	-	14,926	553,812
騰訊控股有限公司	20,115	925,061	-	15,202	929,974
Thai Oil PCL - Foreign	3,400	146,186	-	678	148,908
Thai Union Group PCL - Foreign	8,000	344,394	-	1,602	350,792
康師傅控股有限公司	8,000	344,233	-	1,602	350,631
TMB Bank PCL - Foreign	55,740	2,398,779	-	11,148	2,443,371
Tower Bersama Infrastructure	8,100	348,570	-	1,620	355,050
創見資訊股份有限公司	-	31,500	-	144	31,356
中國民航信息網絡股份有限公司-H股	3,000	128,800	-	600	131,200
True Corp PCL (FR)	36,300	1,585,552	544	7,368	1,615,028
青島啤酒股份有限公司-H股	2,000	59,031	-	12,228	48,803
UMW Holdings BHD	2,500	107,456	-	498	109,458
Unilever Indonesia TBK PT	5,200	249,666	-	1,158	253,708
統一企業股份有限公司	18,999	789,624	-	16,612	792,011
聯華電子股份有限公司	42,000	1,807,503	-	8,400	1,841,103
大華銀行有限公司	5,129	214,726	-	5,078	214,777
United Tractors TBK PT	7,100	297,646	-	42,922	261,824
Universal Robina Corp	3,680	145,099	-	6,878	141,901
UOL Group Ltd	2,000	86,133	-	402	87,731
世界先進積體電路股份有限公司	3,600	154,920	-	720	157,800
唯品會控股有限公司-ADR	657	65,620	-	300	65,977
中國旺旺控股有限公司	25,000	1,034,702	-	106,878	952,824
Waskita Karya Persero TBK PT	-	785,491	-	3,570	781,921
新浪微博-Spon ADR	-	5,277	-	-	5,277
濰柴動力股份有限公司-H股	4,000	171,967	-	798	175,169
Westports Holdings BHD	4,300	184,916	-	858	188,358
萬州國際有限公司	24,500	1,291,173	-	42,850	1,272,823
九龍倉集團有限公司	5,444	220,387	-	7,002	218,829
會德豐有限公司	3,000	128,800	-	600	131,200
豐益國際有限公司	8,100	319,436	-	15,028	312,508
緯創資通股份有限公司	10,306	444,978	5,856	60,124	401,016
Woori Bank	1,424	51,924	-	4,574	48,774
大聯大投資控股股份有限公司	6,000	258,200	-	1,200	263,000

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
永利澳門有限公司	6,400	272,775	-	24,078	255,097
XI Axiata TBK PT	12,720	547,384	-	2,544	557,560
揚子江船業(控股)有限公司	8,100	348,560	-	1,620	355,040
兗州煤業股份有限公司-H股	8,000	344,233	-	1,602	350,631
Youku Tudou Inc - ADR	196	-	-	196	-
YTL Corp BHD	18,100	778,873	-	3,618	793,355
YTL Power International BHD	7,860	338,242	-	1,572	344,530
元大金融控股股份有限公司	36,943	1,589,728	-	7,392	1,619,279
裕元工業(集團)有限公司	3,000	128,800	-	600	131,200
越秀地產股份有限公司	28,000	364,026	-	392,026	-
Yuhan Corp	26	1,190	60	6	1,270
裕隆汽車製造股份有限公司	3,600	154,920	-	720	157,800
百勝中國控股有限公司	-	65,437	-	-	65,437
歡聚時代-ADR	-	4,887	-	24	4,863
浙江滬杭甬高速公路股份有限公司-H股	6,000	257,472	-	1,200	262,272
臻鼎科技控股股份有限公司	1,200	51,640	-	240	52,600
株州中車時代電氣股份有限公司-H股(前稱株州南車時代電氣股份有限公司-H股)	2,000	86,133	-	402	87,731
紫金礦業集團股份有限公司-H股	24,000	1,032,402	-	4,800	1,051,602
中興通訊股份有限公司-H股	3,200	137,753	-	642	140,311
<b>交易所買賣基金</b>					
iShares 安碩 MSCI 印度指數 ETF	172,280	7,773,075	-	71,474	7,873,881
<b>上市供股權</b>					
BNK Financial Group Inc-供股權	198	-	-	198	-
華潤啤酒(控股)有限公司-供股權	-	-	25,600	25,600	-
Gamuda BHD-供股權	-	-	1,150	1,150	-
保利協鑫能源控股有限公司-供股權	9,200	-	-	9,200	-
Jasa Marga (Persero) TBK PT-供股權	-	-	21,557	21,557	-
Noble Group Ltd-供股權	-	-	318,430	318,430	-
Samsung Heavy Industries-供股權	-	-	11,397	11,397	-
True Corp PCL (FR)-供股權	-	12,378	12,378	24,756	-
XI Axiata TBK PT-供股權	-	-	3,180	3,180	-
<b>上市認股權證</b>					
Banpu Public Co Ltd - Foreign-認股權證	-	2,190	-	2,190	-
<b>非上市股本</b>					
RHB Capital BHD	2,933	79,217	-	41,075	41,075

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>非上市供股權</b>					
Ascendas Real Estate Inv Trt – 供股權	322	-	-	322	-
Banpu Public Co Ltd - For Reg – 供股權	-	-	7,279	7,279	-
國泰金融控股股份有限公司 – 供股權	-	-	118,874	59,437	59,437
Eclat Textile Company Ltd – 供股權	-	-	9	9	-
富邦金融控股股份有限公司 – 供股權	-	-	2,356	2,356	-
Hanwha Corporation – 供股權	-	-	928	928	-
台新金融控股股份有限公司 – 供股權	-	-	88,382	44,191	44,191

# iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF(前稱 iShares 安碩 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF)

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 港元	成分基金交易 資產淨值 港元
截至下列日期財務期間結束時		
二零一四年十二月三十一日	42.54	102,094,387
二零一五年十二月三十一日	38.32	91,969,720
二零一六年十二月三十一日	40.04	4,212,113,896

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 港元	最低每單位 資產淨值 港元
截至下列日期止財務期間		
二零零九年十二月三十一日(自成立以來)	35.66	20.00
二零一零年十二月三十一日	40.74	31.39
二零一一年十二月三十一日	42.76	30.78
二零一二年十二月三十一日	41.51	33.48
二零一三年十二月三十一日	43.78	35.61
二零一四年十二月三十一日	46.45	38.33
二零一五年十二月三十一日	49.56	36.60
二零一六年十二月三十一日	43.99	33.73

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)</b>			
<b>中國(38.21%)</b>			
58同城—ADR	439	95,302	0.08
瑞聲科技控股有限公司	4,470	314,911	0.26
中國農業銀行—H股	133,942	425,936	0.36
阿里巴巴集團控股有限公司—SP ADR	6,338	4,314,936	3.62
阿里巴巴健康信息技術有限公司	13,500	52,650	0.04
阿里巴巴影業集團有限公司	58,333	73,500	0.06
中國鋁業股份有限公司—H股	17,032	54,502	0.05
安徽海螺水泥股份有限公司—H股	8,432	177,915	0.15
安踏體育用品有限公司	5,250	121,537	0.10
中國航空科技工業—H股	12,000	64,080	0.05
百度股份有限公司—Spon ADR	1,528	1,947,735	1.63
中國銀行股份有限公司—H股	454,812	1,564,553	1.31
交通銀行股份有限公司—H股	56,557	317,285	0.27
北京首都國際機場—H股	14,577	114,284	0.10
北京控股有限公司	4,159	152,427	0.13
北控水務集團有限公司	28,042	144,697	0.12
百麗國際控股有限公司	30,000	130,800	0.11
華晨中國汽車控股有限公司	21,000	224,280	0.19
比亞迪股份有限公司—H股	4,132	168,792	0.14
中國廣核電力股份有限公司—H股	57,501	122,477	0.10
中國信達資產管理股份有限公司—H股	42,501	119,428	0.10
中信銀行股份有限公司—H股	33,000	162,690	0.14
中國中煤能源股份有限公司—H股	22,791	83,871	0.07
中國交通建設股份有限公司—H股	27,396	244,372	0.20
中國海螺創業控股有限公司	4,812	66,406	0.06
中國建設銀行—H股	455,134	2,717,150	2.28
中國光大國際有限公司	17,992	158,150	0.13
中國光大控股有限公司	9,286	137,061	0.11
中國恒大集團(前稱恒大地產集團)	32,812	158,482	0.13
中國銀河證券股份有限公司—H股	21,094	147,447	0.12
中國燃氣控股有限公司	15,000	157,800	0.13
中國華融資產管理—H股	28,000	78,120	0.07
中國輝山乳業控股有限公司	11,250	33,862	0.03
中國人壽保險股份有限公司—H股	42,359	855,652	0.72
龍源電力集團股份有限公司—H股	21,086	127,781	0.11
康哲藥業控股有限公司	10,500	128,940	0.11
中國蒙牛乳業有限公司	17,404	260,016	0.22
招商銀行—H股	24,008	436,465	0.37
招商局港口控股有限公司(前稱招商局國際有限公司)	7,942	152,804	0.13

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)(續)</b>			
<b>中國(38.21%)(續)</b>			
中國民生銀行—H股	40,444	335,281	0.28
中國移動有限公司	34,807	2,861,135	2.40
中國建材股份有限公司—H股	22,500	84,825	0.07
中海油田服務股份有限公司—H股	10,252	73,814	0.06
中國海外發展有限公司	23,437	481,630	0.40
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—H股	15,750	426,037	0.36
中國石油化工有限公司—H股	144,038	792,209	0.66
中國鐵建股份有限公司—H股	13,462	134,351	0.11
中國中鐵股份有限公司—H股	26,346	168,087	0.14
華潤啤酒(控股)有限公司	10,539	162,301	0.14
華潤燃氣控股有限公司	5,216	113,709	0.10
華潤置地有限公司	18,334	319,745	0.27
華潤電力控股有限公司	11,332	139,610	0.12
中國神華能源股份有限公司—H股	21,068	307,593	0.26
中國建築國際集團有限公司	6,631	76,920	0.06
中國太平保險控股有限公司	11,158	178,528	0.15
中國電信股份有限公司—H股	92,499	331,146	0.28
中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司	39,675	358,265	0.30
萬科企業股份有限公司—H股	7,500	132,750	0.11
重慶長安汽車股份有限公司—B股	7,834	86,879	0.07
重慶農村商業銀行—H股	18,744	85,285	0.07
中國中信股份有限公司	27,917	309,879	0.26
中信證券股份有限公司—H股	7,312	115,237	0.10
中國海洋石油有限公司	104,147	1,010,226	0.85
中遠海運港口有限公司(前稱中遠太平洋有限公司)	14,307	111,452	0.09
碧桂園控股有限公司	24,213	105,084	0.09
中國中車股份有限公司—H股	23,062	160,512	0.13
石藥集團有限公司	32,209	266,691	0.22
攜程旅行網—ADR	1,929	598,233	0.50
東風汽車集團股份有限公司—H股	20,548	155,548	0.13
新奧能源控股有限公司	4,189	133,629	0.11
遠東宏信有限公司	11,666	77,579	0.06
復星國際有限公司	17,699	194,335	0.16
豐盛控股有限公司	37,500	135,750	0.11
福耀玻璃工業集團股份有限公司—H股	2,800	67,340	0.06
保利協鑫能源控股有限公司	57,817	53,770	0.04
吉利汽車控股有限公司	32,083	237,735	0.20
廣發證券股份有限公司—H股	7,500	121,350	0.10
國美電器控股有限公司	93,750	88,125	0.07
長城汽車股份有限公司—H股	13,566	98,218	0.08

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)(續)</b>			
<b>中國(38.21%)(續)</b>			
粵海投資有限公司	20,698	211,948	0.18
廣州汽車集團股份有限公司—H股	6,000	56,280	0.05
海爾電器集團有限公司	6,869	83,802	0.07
海通證券股份有限公司—H股	13,333	177,329	0.15
漢能薄膜發電集團有限公司	57,143	1	0.00
恒安國際集團有限公司	5,220	297,279	0.25
恒騰網絡集團有限公司	124,000	48,360	0.04
華能國際電力股份有限公司—H股	22,432	115,300	0.10
華泰證券股份有限公司—H股	3,187	47,168	0.04
中國工商銀行—H股	413,975	1,924,984	1.61
京東商城電子商務有限公司—ADR	3,928	774,759	0.65
江蘇寧滬高速公路股份有限公司—H股	5,488	53,782	0.05
江西銅業股份有限公司—H股	9,030	97,705	0.08
金山軟件有限公司	3,750	59,625	0.05
昆侖能源有限公司	21,000	121,800	0.10
聯想集團有限公司	43,500	204,450	0.17
網易公司—ADR	451	752,973	0.63
新華人壽保險股份有限公司—H股	5,001	178,036	0.15
新東方教育科技集團—SP ADR	760	248,070	0.21
玖龍紙業(控股)有限公司	11,250	79,087	0.07
中國人民保險集團股份有限公司—H股	24,999	76,497	0.06
中國石油天然氣股份有限公司—H股	116,692	674,480	0.57
中國人民財產保險股份有限公司—H股	21,517	259,925	0.22
中國平安保險(集團)股份有限公司—H股	31,037	1,204,236	1.01
Qunar Cayman Islands Ltd—ADR	243	56,765	0.05
中芯國際集成電路製造有限公司	19,275	234,769	0.20
山東威高集團醫用高分子製品股份有限公司—H股	9,238	47,853	0.04
上海電氣集團總公司—H股	10,000	34,700	0.03
上海復星醫藥(集團)股份有限公司—H股	1,875	44,531	0.04
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司—B股	3,728	42,315	0.04
上海醫藥集團股份有限公司—H股	4,492	79,868	0.07
申洲國際集團	3,549	174,078	0.15
世茂房地產控股有限公司	10,781	109,319	0.09
新浪公司	320	150,820	0.13
中國生物製藥有限公司	26,932	147,049	0.12
遠洋集團控股有限公司(前稱遠洋地產控股有限公司)	20,888	72,481	0.06
中國石化上海石油化工股份有限公司—H股	33,353	140,083	0.12
國藥控股股份有限公司—H股	6,787	216,845	0.18
中國外運股份有限公司—H股	12,000	41,520	0.03
Soho中國有限公司	14,163	54,103	0.05

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)(續)</b>			
<b>中國(38.21%)(續)</b>			
舜宇光學科技(集團)有限公司	4,000	135,800	0.11
好未來教育集團—ADR	241	131,076	0.11
騰訊控股有限公司	30,872	5,856,418	4.91
康師傅控股有限公司	14,407	135,858	0.11
中國民航信息網絡股份有限公司—H股	2,812	45,836	0.04
青島啤酒股份有限公司—H股	2,842	83,271	0.07
唯品會控股有限公司—ADR	2,294	195,821	0.16
中國旺旺控股有限公司	38,032	189,019	0.16
新浪微博—Spon ADR	181	56,975	0.05
百勝中國控股有限公司	2,321	470,031	0.39
歡聚時代—ADR	167	51,040	0.04
浙江滬杭甬高速公路股份有限公司—H股	7,299	54,013	0.05
株洲南車時代電氣股份有限公司—H股	3,594	141,424	0.12
紫金礦業集團股份有限公司—H股	38,332	95,830	0.08
中興通訊股份有限公司—H股	2,340	31,543	0.03
		45,568,819	38.21
<b>印尼(3.77%)</b>			
Adaro Energy TBK PT	52,500	51,211	0.04
Astra International TBK PT	122,863	585,085	0.49
Bank Central Asia TBK PT	69,551	620,390	0.52
Bank Danamon Indonesia TBK	31,875	68,054	0.06
Bank Mandiri Persero TBK PT	57,112	380,433	0.32
Bank Negara Indonesia Perser	50,625	160,964	0.13
Bank Rakyat Indonesia Perser	67,532	453,729	0.38
Charoen Pokphand Indonesi PT	41,250	73,352	0.06
Gudang Garam TBK PT	1,875	68,950	0.06
Hm Sampoerna TBK PT	16,406	36,160	0.03
Indocement Tunggul Prakarsa	5,625	49,851	0.04
Indofood Sukses Makmur TBK P	37,500	171,025	0.14
Jasa Marga (Persero) TBK PT	20,012	49,751	0.04
Kalbe Farma TBK PT	138,382	120,649	0.10
Lippo Karawaci TBK PT	94,252	39,053	0.03
Matahari Department Store TB	18,008	156,744	0.13
Media Nusantara Citra TBK PT	29,746	30,043	0.03
Pakuwon Jati TBK PT	135,900	44,187	0.04
Perusahaan Gas Negara Perser	90,000	139,842	0.12
Semen Indonesia Persero TBK	15,000	79,200	0.07
Surya Citra Media PT TBK	29,347	47,288	0.04
Telekomunikasi Indonesia Per	322,481	738,613	0.62
Tower Bersama Infrastructure	15,652	44,857	0.04

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)(續)</b>			
<b>印尼(3.77%)(續)</b>			
Unilever Indonesia TBK PT	8,719	194,683	0.16
United Tractors TBK PT	7,500	91,717	0.08
		4,495,831	3.77
<b>馬來西亞(3.18%)</b>			
Airasia BHD	9,375	37,104	0.03
Alliance Financial Group BHD	7,350	47,255	0.04
AMMB Holdings BHD	6,900	51,398	0.04
Axiata Group Berhad	8,152	66,501	0.06
British American Tobacco BHD	600	46,249	0.04
Cimb Group Holdings BHD	25,404	198,015	0.17
Digi.Com BHD	31,932	266,558	0.22
Gamuda BHD	6,000	49,568	0.04
Genting BHD	9,733	134,572	0.11
Genting Malaysia BHD	24,474	193,727	0.16
Genting Plantations BHD	1,500	27,999	0.02
Hap Seng Consolidated	2,812	43,059	0.04
IHH Healthcare BHD	18,584	203,954	0.17
IJM Corp BHD	11,062	61,179	0.05
IOI Corp BHD	28,260	214,904	0.18
IOI Properties Group BHD	35,949	130,474	0.11
Kuala Lumpur Kepong BHD	2,751	114,109	0.10
Malayan Banking BHD	22,140	313,769	0.26
Maxis BHD	6,656	68,791	0.06
MISC BHD	2,200	27,947	0.02
Petronas Chemicals Group BHD	11,291	136,209	0.12
Petronas Gas BHD	2,437	89,713	0.08
Public Bank Berhad	12,669	431,786	0.36
Sapurakencana Petroleum BHD	28,294	79,219	0.07
Sime Darby Berhad	17,940	251,146	0.21
Tenaga Nasional BHD	19,387	465,741	0.39
YTL Corp BHD	14,812	39,679	0.03
		3,790,625	3.18
<b>菲律賓(1.78%)</b>			
Aboitiz Equity Ventures Inc	12,000	132,503	0.11
Alliance Global Group Inc	37,725	75,192	0.06
Ayala Corporation	1,627	185,362	0.16
Ayala Land Inc	30,375	151,593	0.13
Bank of The Philippine Islan	4,372	60,549	0.05
BDO Unibank Inc	13,125	229,465	0.19

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)(續)</b>			
<b>菲律賓(1.78%)(續)</b>			
Energy Development Corp	81,750	65,661	0.05
GT Capital Holdings Inc	192	38,029	0.03
Intl Container Term Svcs Inc	8,906	99,937	0.08
JG Summit Holdings Inc	22,500	237,390	0.20
Jollibee Foods Corp	5,325	161,114	0.14
Metro Pacific Investments Co	24,400	25,344	0.02
Metropolitan Bank & Trust	5,887	66,657	0.06
PLDT Inc (前稱 Philippine Long Distance Tel)	533	113,468	0.10
SM Investments Corp	935	95,514	0.08
SM Prime Holdings Inc	42,000	185,701	0.16
Universal Robina Corp	7,500	191,246	0.16
		2,114,725	1.78
<b>南韓(20.75%)</b>			
Amorepacific Corp	191	394,183	0.33
Amorepacific Corp - 優先股	21	27,702	0.02
Amorepacific Group	123	105,012	0.09
BGF Retail Co Ltd	86	45,158	0.04
BNK Financial Group Inc	1,597	88,983	0.07
Celltrion Inc	531	366,085	0.31
Cheil Worldwide Inc	334	33,768	0.03
CJ Cheiljedang Corp	37	84,910	0.07
CJ Corp	111	133,244	0.11
CJ E&M Corp	59	26,852	0.02
CJ Korea Express Corp	21	24,130	0.02
Coway Co Ltd	322	182,515	0.15
Daelim Industrial Co Ltd	172	96,168	0.08
Dongbu Insurance Co Ltd	170	68,204	0.06
E-Mart Inc	160	187,955	0.16
GS Engineering & Construct	289	49,162	0.04
GS Holdings	143	49,661	0.04
GS Retail Co Ltd	82	25,056	0.02
Hana Financial Group	1,674	335,806	0.28
Hankook Tire Co Ltd	352	131,055	0.11
Hanmi Pharm Co Ltd	29	56,871	0.05
Hanmi Science Co Ltd	59	23,141	0.02
Hanon Systems	393	25,984	0.02
Hanssem Co Ltd	35	44,710	0.04
Hanwha Chemical Corp	877	139,053	0.12
Hanwha Corporation	412	92,698	0.08

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
上市股本(87.69%)(續)			
南韓(20.75%)(續)			
Hanwha Techwin Co Ltd	210	58,572	0.05
Hotel Shilla Co Ltd	215	66,453	0.06
Hyosung Corporation	97	90,598	0.08
Hyundai Dept Store Co	120	83,964	0.07
Hyundai Development Co-Engin	327	94,354	0.08
Hyundai Engineering & Const	472	129,679	0.11
Hyundai Glovis Co Ltd	74	73,391	0.06
Hyundai Heavy Industries	294	274,596	0.23
Hyundai Marine & Fire Ins Co	368	74,412	0.06
Hyundai Mobis Co Ltd	419	710,070	0.60
Hyundai Motor Co	866	811,622	0.68
Hyundai Motor Co Ltd - 第二優先股	42	26,799	0.02
Hyundai Steel Co	508	185,875	0.16
Hyundai Wia Corp	82	38,426	0.03
Industrial Bank of Korea	872	71,089	0.06
Kakao Corp	172	85,016	0.07
Kangwon Land Inc	652	149,626	0.13
KB Financial Group Inc	2,208	606,633	0.51
KCC Corp	47	108,463	0.09
Kepco Plant Service & Engine	94	32,705	0.03
KIA Motors Corp	1,660	418,245	0.35
Korea Aerospace Industries	312	134,188	0.11
Korea Electric Power Corp	1,429	404,074	0.34
Korea Investment Holdings Co	391	105,166	0.09
Korea Zinc Co Ltd	58	176,850	0.15
Korean Air Lines Co Ltd	430	75,493	0.06
KT&G Corp	599	388,357	0.33
Kumho Petrochemical Co Ltd	102	53,690	0.04
LG Chem Ltd	289	484,196	0.41
LG Chem Ltd—優先股	47	54,156	0.04
LG Corp	730	281,162	0.24
LG Display Co Ltd	1,548	312,518	0.26
LG Electronics Inc	619	205,033	0.17
LG Household & Health Care	55	302,571	0.25
LG Uplus Corp	1,101	80,924	0.07
Lotte Chemical Corp	120	284,244	0.24
Lotte Confectionery Co Ltd	84	96,250	0.08
Lotte Shopping Co	75	106,639	0.09
Mirae Asset Daewoo Co Ltd (前稱 Daewoo Securities Co Ltd)	1,627	75,615	0.06
Mirae Asset Securities Co Lt	684	90,010	0.07

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)(續)</b>			
<b>南韓(20.75%)(續)</b>			
Naver Corp	164	815,885	0.68
Ncsoft Corp	84	133,456	0.11
NH Investment & Securities C	1,575	97,564	0.08
OCI Co Ltd	112	56,582	0.05
Orion Corp	22	92,501	0.08
POSCO	398	657,875	0.55
S-1 Corporation	66	37,156	0.03
Samsung Biologics Co Ltd	93	90,145	0.08
Samsung C&T Corp	466	375,416	0.31
Samsung Card Co	450	114,680	0.10
Samsung Electro-Mechanics Co	314	102,394	0.09
Samsung Electronics－優先股	102	938,274	0.79
Samsung Electronics Co Ltd	549	6,350,535	5.33
Samsung Fire & Marine Ins	238	410,208	0.34
Samsung Heavy Industries	756	44,890	0.04
Samsung Life Insurance Co Ltd	412	297,531	0.25
Samsung Sdi Co Ltd	313	219,005	0.18
Samsung Sds Co Ltd	192	171,933	0.14
Samsung Securities Co Ltd	369	75,088	0.06
Shinhan Financial Group Ltd	2,314	672,148	0.56
Shinsegae Inc	76	85,864	0.07
SK Holdings Co Ltd	253	372,723	0.31
SK Hynix Inc	3,389	972,439	0.82
SK Innovation Co Ltd	434	408,141	0.34
SK Telecom	78	112,157	0.09
S-Oil Corp	187	101,674	0.09
Woori Bank	1,862	152,396	0.13
Yuhan Corp	37	47,384	0.04
		24,745,834	20.75
<b>台灣(16.77%)</b>			
宏碁股份有限公司	37,970	119,658	0.10
日月光半導體製造股份有限公司	46,632	370,755	0.31
研華股份有限公司	937	57,367	0.05
亞洲水泥股份有限公司	4,000	25,356	0.02
華碩電腦股份有限公司	5,394	343,865	0.29
友達光電股份有限公司	75,892	215,432	0.18
可成科技股份有限公司	3,750	202,074	0.17
國泰金融控股股份有限公司	45,629	529,078	0.44
中租控股股份有限公司	7,707	102,157	0.09
正新橡膠工業股份有限公司	14,750	215,738	0.18

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)(續)</b>			
<b>台灣(16.77%)(續)</b>			
中華航空股份有限公司	18,750	41,948	0.03
中華開發金融控股股份有限公司	77,812	150,874	0.13
中國人壽保險股份有限公司	7,820	60,293	0.05
中國鋼鐵股份有限公司	73,228	434,236	0.36
中華電信股份有限公司	21,312	520,381	0.44
仁寶電腦工業股份有限公司	42,549	188,850	0.16
中國信託金融控股股份有限公司	102,874	436,799	0.37
台達電子工業股份有限公司	13,050	500,729	0.42
玉山金融控股股份有限公司	35,999	158,912	0.13
儒鴻企業股份有限公司	1,546	125,520	0.11
長榮航空股份有限公司	13,744	48,272	0.04
遠傳電信股份有限公司	9,999	174,392	0.15
豐泰企業股份有限公司	2,000	57,976	0.05
第一金融控股股份有限公司	26,123	108,089	0.09
台灣化學纖維股份有限公司	15,450	357,920	0.30
台塑石化股份有限公司	2,875	77,462	0.06
台灣塑膠工業股份有限公司	23,566	505,687	0.42
鴻準精密工業股份有限公司	2,020	41,451	0.03
富邦金融控股股份有限公司	32,797	402,379	0.34
巨大機械工業股份有限公司	832	36,627	0.03
鴻海精密工業股份有限公司	86,994	1,762,109	1.48
和泰汽車股份有限公司	1,756	155,877	0.13
宏達國際電子股份有限公司	3,573	67,903	0.06
華南金融控股股份有限公司	10,620	41,515	0.03
群創光電	51,556	143,869	0.12
英業達股份有限公司	10,000	53,165	0.04
大立光電股份有限公司	532	485,045	0.41
光寶科技股份有限公司	17,508	204,694	0.17
聯發科技股份有限公司	8,905	463,792	0.39
兆豐金融控股股份有限公司	40,117	221,967	0.19
美利達工業股份有限公司	1,775	61,488	0.05
微星科技股份有限公司	4,000	70,822	0.06
南亞塑膠工業股份有限公司	27,197	465,835	0.39
億豐綜合工業股份有限公司	1,000	79,988	0.07
聯詠科技股份有限公司	1,667	42,709	0.04
浩鼎生技股份有限公司	937	64,242	0.05
和碩聯合科技股份有限公司	10,864	201,239	0.17
寶成	20,625	199,458	0.17
統一超商股份有限公司	3,334	185,272	0.16
廣達電腦股份有限公司	11,250	163,193	0.14
瑞昱半導體股份有限公司	2,000	49,075	0.04

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)(續)</b>			
<b>台灣(16.77%)(續)</b>			
矽品精密工業股份有限公司	11,941	137,453	0.11
永豐金融控股股份有限公司	39,183	85,588	0.07
聯強國際股份有限公司	11,812	92,350	0.08
中裕新藥股份有限公司	937	37,531	0.03
台新金融控股股份有限公司	28,012	79,517	0.07
台灣中小企業銀行股份有限公司	65,733	128,876	0.11
台灣水泥股份有限公司	28,512	241,093	0.20
合作金庫金融控股股份有限公司	44,582	150,684	0.13
台灣肥料股份有限公司	4,000	38,635	0.03
台灣大哥大股份有限公司	9,625	240,805	0.20
台灣積體電路製造股份有限公司	137,420	6,000,092	5.03
東元電機股份有限公司	4,000	26,847	0.02
統一企業股份有限公司	27,466	352,832	0.30
聯華電子股份有限公司	88,812	243,561	0.20
世界先進積體電路股份有限公司	1,667	22,537	0.02
緯創資通股份有限公司	6,758	40,562	0.03
大聯大投資控股股份有限公司	3,000	27,424	0.02
元大金融控股股份有限公司	88,982	256,871	0.22
		19,996,792	16.77
<b>泰國(3.23%)</b>			
Advanced Info Service PCL (FR)	7,578	241,179	0.20
Airports of Thailand PCL (FR)	3,718	320,376	0.27
Bangkok Bank PCL - Foreign Reg	3,850	132,950	0.11
Bangkok Dusit Medical Services PCL (FR)	26,250	131,283	0.11
Bangkok Expressway and Metro (FR)	30,400	49,034	0.04
BEC World PCL (FR)	8,625	30,998	0.03
Berli Jucker Pub Co (FR)	6,700	72,892	0.06
BTS Group Holdings PCL (FR)	37,432	69,291	0.06
Bumrungrad Hospital (FR)	1,125	44,086	0.04
C.P. All PCL (FR)	24,750	334,906	0.28
Central Pattana PCL (FR)	5,250	64,505	0.05
Charoen Pokphand Foods Co Ltd (FR)	19,500	124,545	0.10
Glow Energy PCL (FR)	4,725	80,816	0.07
Home Product Center PCL (FR)	34,721	76,676	0.06
Indorama Ventures PCL (FR)	14,250	103,354	0.09
Kasikornbank PCL - Foreign	8,396	322,655	0.27
KCE Electronics PCL (FR)	1,600	42,262	0.04
Krung Thai Bank PCL (FR)	17,212	65,959	0.06
Minor International PCL (FR)	9,375	72,563	0.06
PTT Exploration & Production PCL (FR)	7,197	149,975	0.13

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.48%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(87.69%)(續)</b>			
<b>泰國(3.23%)(續)</b>			
PTT Global Chemical PCL (FR)	12,712	173,389	0.14
PTT PCL (FR)	6,562	528,502	0.44
Siam Cement Pub Co (FR)	1,738	186,638	0.16
Siam Commercial Bank PCL (FR)	9,891	326,571	0.27
Thai Oil PCL (FR)	2,062	32,255	0.03
True Corp PCL (FR)	50,245	77,780	0.06
		3,855,440	3.23
總上市股本		104,568,066	87.69
<b>交易所買賣基金(11.79%)</b>			
<b>印度(11.79%)</b>			
iShares安碩亞洲信託基金－iShares安碩標普BSE Sensex印度指數ETF	799,157	14,065,163	11.79
		14,065,163	11.79
<b>非上市供股權(0.00%)</b>			
<b>台灣(0.00%)</b>			
國泰金融控股股份有限公司－供股權	3,057	-	-
台新金融控股股份有限公司－供股權	1,063	-	-
非上市供股權總額		-	-
投資總額		118,633,229	99.48
其他資產淨值		615,371	0.52
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		119,248,600	100.00
投資總額(按成本)		117,372,760	

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
58同城—ADR	241	227	-	29	439
瑞聲科技控股有限公司	4,768	-	-	298	4,470
Aboitiz Equity Ventures Inc	12,800	-	-	800	12,000
宏碁股份有限公司	61,501	40,501	-	64,032	37,970
Adaro Energy TBK PT	56,000	-	-	3,500	52,500
Advanced Info Service PCL (FR)	10,783	-	-	3,205	7,578
日月光半導體製造股份有限公司	54,741	-	-	8,109	46,632
研華股份有限公司	-	1,000	-	63	937
中國農業銀行—H股	142,871	-	-	8,929	133,942
Airasia BHD	10,000	-	-	625	9,375
Airports of Thailand PCL (FR)	3,966	-	-	248	3,718
阿里巴巴集團控股有限公司—SP ADR	3,288	3,478	-	428	6,338
阿里巴巴健康信息技術有限公司	14,400	-	-	900	13,500
阿里巴巴影業集團有限公司	62,222	-	-	3,889	58,333
Alliance Financial Group BHD	7,840	-	-	490	7,350
Alliance Global Group Inc	40,240	-	-	2,515	37,725
中國鋁業股份有限公司—H股	18,168	-	-	1,136	17,032
AMMB Holdings BHD	-	6,900	-	-	6,900
Amorepacific Corp	204	-	-	13	191
Amorepacific Corp—優先股	-	22	-	1	21
Amorepacific Group	83	48	-	8	123
安徽海螺水泥股份有限公司—H股	12,494	-	-	4,062	8,432
安踏體育用品有限公司	5,600	-	-	350	5,250
亞洲水泥股份有限公司	-	4,000	-	-	4,000
Astra Agro Lestari TBK PT	4,000	-	-	4,000	-
Astra International TBK PT	146,254	-	-	23,391	122,863
華碩電腦股份有限公司	6,820	-	-	1,426	5,394
友達光電股份有限公司	95,952	-	-	20,060	75,892
中國航空科技工業—H股	12,800	-	-	800	12,000
Axiata Group Berhad	8,696	-	-	544	8,152
Ayala Corporation	1,736	-	-	109	1,627
Ayala Land Inc	32,400	-	-	2,025	30,375
百度股份有限公司—Spon ADR	904	750	-	126	1,528
Bangkok Bank PCL - Foreign Reg	5,600	-	-	1,750	3,850
Bangkok Dusit Medical Services PCL (FR)	28,000	-	-	1,750	26,250
Bangkok Expressway and Metro	-	30,400	-	30,400	-
Bangkok Expressway and Metro (FR)	-	30,400	-	-	30,400
Bank Central Asia TBK PT	81,334	-	-	11,783	69,551
Bank Cimb Niaga TBK PT	-	5,685	-	5,685	-
Bank Danamon Indonesia TBK	34,000	-	-	2,125	31,875
Bank Mandiri Persero TBK PT	80,000	-	-	22,888	57,112

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Bank Negara Indonesia Perser	54,000	-	-	3,375	50,625
中國銀行股份有限公司—H股	512,800	-	-	57,988	454,812
交通銀行股份有限公司—H股	60,327	-	-	3,770	56,557
Bank of The Philippine Islan	4,663	-	-	291	4,372
Bank Rakyat Indonesia Perser	84,534	-	-	17,002	67,532
BDO Unibank Inc	14,000	-	-	875	13,125
BEC World PCL (FR)	9,200	-	-	575	8,625
北京首都國際機場—H股	15,549	-	-	972	14,577
北京控股有限公司	4,436	-	-	277	4,159
北控水務集團有限公司	29,912	-	-	1,870	28,042
百麗國際控股有限公司	32,000	-	-	2,000	30,000
Berli Jucker Pub Co (FR)	-	6,700	-	-	6,700
Berli Jucker Public Co - NVDR	-	6,700	-	6,700	-
BGF Retail Co Ltd	-	46	43	3	86
BNK Financial Group Inc	1,368	336	-	107	1,597
華晨中國汽車控股有限公司	22,400	-	-	1,400	21,000
British American Tobacco BHD	-	600	-	-	600
BTS Group Holdings PCL (FR)	39,928	-	-	2,496	37,432
Bumrungrad Hospital (FR)	-	1,200	-	75	1,125
Bumrungrad Hospital Pub Co	-	1,200	-	1,200	-
比亞迪股份有限公司—H股	5,907	-	-	1,775	4,132
C.P. All PCL (FR)	26,400	-	-	1,650	24,750
可成科技股份有限公司	4,000	-	-	250	3,750
國泰金融控股股份有限公司	65,471	-	-	19,842	45,629
Celltrion Inc	601	-	25	95	531
Central Pattana PCL (FR)	5,600	-	-	350	5,250
中國廣核電力股份有限公司—H股	61,334	-	-	3,833	57,501
中租控股股份有限公司	8,221	-	-	514	7,707
Charoen Pokphand Foods Co Ltd (FR)	20,800	-	-	1,300	19,500
Charoen Pokphand Indonesi PT	44,000	-	-	2,750	41,250
Cheil Worldwide Inc	648	-	-	314	334
正新橡膠工業股份有限公司	15,733	-	-	983	14,750
中華航空股份有限公司	20,000	-	-	1,250	18,750
中國信達資產管理股份有限公司—H股	45,334	-	-	2,833	42,501
中信銀行股份有限公司—H股	35,200	-	-	2,200	33,000
中國中煤能源股份有限公司—H股	44,310	-	-	21,519	22,791
中國交通建設股份有限公司—H股	38,222	-	-	10,826	27,396
中國海螺創業控股有限公司	-	5,000	-	188	4,812
中國建設銀行—H股	530,810	-	-	75,676	455,134
中華開發金融控股股份有限公司	100,000	-	-	22,188	77,812
中國光大國際有限公司	19,192	-	-	1,200	17,992

# iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
中國光大控股有限公司	9,905	-	-	619	9,286
中國恒大集團(前稱恒大地產集團)	44,000	-	-	11,188	32,812
中國銀河證券股份有限公司-H股	28,000	-	-	6,906	21,094
中國燃氣控股有限公司	16,000	-	-	1,000	15,000
中國華融資產管理-H股	-	28,000	-	-	28,000
中國輝山乳業控股有限公司	-	12,000	-	750	11,250
中國人壽保險股份有限公司-H股	50,183	-	-	7,824	42,359
中國人壽保險股份有限公司	-	8,000	320	500	7,820
龍源電力集團股份有限公司-H股	32,492	-	-	11,406	21,086
康哲藥業控股有限公司	11,200	-	-	700	10,500
中國蒙牛乳業有限公司	21,564	-	-	4,160	17,404
招商銀行-H股	32,609	-	-	8,601	24,008
招商局港口控股有限公司(前稱招商局國際有限公司)	8,472	-	-	530	7,942
中國民生銀行-H股	50,640	-	-	10,196	40,444
中國移動有限公司	40,194	-	-	5,387	34,807
中國建材股份有限公司-H股	24,000	-	-	1,500	22,500
中海油田服務股份有限公司-H股	10,936	-	-	684	10,252
中國海外發展有限公司	29,133	-	-	5,696	23,437
中國太平洋保險(集團)股份有限公司-H股	16,800	-	-	1,050	15,750
中國石油化工股份有限公司-H股	176,174	-	-	32,136	144,038
中國鐵建股份有限公司-H股	18,360	-	-	4,898	13,462
中國中鐵股份有限公司-H股	39,102	-	-	12,756	26,346
華潤啤酒(控股)有限公司	10,293	2,764	-	2,518	10,539
華潤燃氣控股有限公司	5,564	-	-	348	5,216
華潤置地有限公司	19,556	-	-	1,222	18,334
華潤電力控股有限公司	16,088	-	-	4,756	11,332
中國神華能源股份有限公司-H股	27,973	-	-	6,905	21,068
中國建築國際集團有限公司	7,073	-	-	442	6,631
中國鋼鐵股份有限公司	110,710	-	-	37,482	73,228
中國太平保險控股有限公司	14,702	-	-	3,544	11,158
中國電信股份有限公司-H股	98,666	-	-	6,167	92,499
中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司	42,320	-	-	2,645	39,675
萬科企業股份有限公司-H股	8,000	-	-	500	7,500
重慶長安汽車股份有限公司-B股	8,356	-	-	522	7,834
重慶農村商業銀行-H股	19,994	-	-	1,250	18,744
中華電信股份有限公司	30,200	-	-	8,888	21,312
Cimb Group Holdings BHD	42,824	-	-	17,420	25,404
中國中信股份有限公司	29,778	-	-	1,861	27,917
中信證券股份有限公司-H股	5,800	2,000	-	488	7,312

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
CJ Cheiljedang Corp	40	-	-	3	37
CJ Corp	146	-	-	35	111
CJ E&M Corp	-	63	-	4	59
CJ Korea Express Corp	-	21	-	-	21
中國海洋石油有限公司	119,090	-	-	14,943	104,147
仁寶電腦工業股份有限公司	62,386	42,549	-	62,386	42,549
中遠海運控股股份有限公司—H股(前稱中國遠洋控 股股份有限公司—H股)	41,435	-	-	41,435	-
中遠海運港口有限公司(前稱中遠太平洋有限公司)	19,261	-	-	4,954	14,307
碧桂園控股有限公司	25,827	-	-	1,614	24,213
Coway Co Ltd	343	-	-	21	322
中國中車股份有限公司—H股	29,600	-	-	6,538	23,062
石藥集團有限公司	40,356	-	-	8,147	32,209
中國信託金融控股股份有限公司	101,604	-	7,620	6,350	102,874
攜程旅行網—ADR	940	1,118	-	129	1,929
Daelim Industrial Co Ltd	184	-	-	12	172
大連萬達商業地產股份有限公司—H股	4,000	-	-	4,000	-
台達電子工業股份有限公司	14,920	-	-	1,870	13,050
Digi.Com BHD	38,647	-	-	6,715	31,932
Dongbu Insurance Co Ltd	-	181	-	11	170
東風汽車集團股份有限公司—H股	21,918	-	-	1,370	20,548
玉山金融控股股份有限公司	34,909	-	3,272	2,182	35,999
儒鴻企業股份有限公司	1,612	37	-	103	1,546
E-Mart Inc	216	-	-	56	160
Energy Development Corp	87,200	-	-	5,450	81,750
新奧能源控股有限公司	6,602	-	-	2,413	4,189
長榮航空股份有限公司	13,963	-	654	873	13,744
房天下控股有限公司—ADR (前稱搜房控股有限公司—ADR)	815	910	-	1,725	-
遠東宏信有限公司	12,444	-	-	778	11,666
遠傳電信股份有限公司	10,666	10,666	-	11,333	9,999
豐泰企業股份有限公司	-	2,000	-	-	2,000
第一金融控股股份有限公司	26,666	-	1,124	1,667	26,123
台灣化學纖維股份有限公司	16,480	-	-	1,030	15,450
台塑石化股份有限公司	-	3,000	-	125	2,875
台灣塑膠工業股份有限公司	31,537	-	-	7,971	23,566
復星國際有限公司	18,879	-	-	1,180	17,699
鴻準精密工業股份有限公司	-	2,000	20	-	2,020
富邦金融控股股份有限公司	34,984	-	-	2,187	32,797
豐盛控股有限公司	-	37,500	-	-	37,500

# iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
福耀玻璃工業集團股份有限公司—H股	-	2,800	-	-	2,800
Gamuda BHD	-	6,000	-	-	6,000
保利協鑫能源控股有限公司	61,671	-	-	3,854	57,817
吉利汽車控股有限公司	34,222	-	-	2,139	32,083
Genting BHD	7,982	2,400	-	649	9,733
Genting Malaysia BHD	42,959	-	-	18,485	24,474
Genting Plantations BHD	1,600	-	-	100	1,500
廣發證券股份有限公司—H股	-	8,000	-	500	7,500
巨大機械工業股份有限公司	888	-	-	56	832
Global Mediacom TBK PT	59,820	-	-	59,820	-
Glow Energy PCL (FR)	5,040	-	-	315	4,725
國美電器控股有限公司	100,000	-	-	6,250	93,750
長城汽車股份有限公司—H股	14,470	-	-	904	13,566
GS Engineering & Construct	422	-	-	133	289
GS Holdings	-	153	-	10	143
GS Retail Co Ltd	-	87	-	5	82
GT Capital Holdings Inc	-	205	-	13	192
粵海投資有限公司	26,345	-	-	5,647	20,698
廣州汽車集團股份有限公司—H股	-	6,000	-	-	6,000
Gudang Garam TBK PT	2,000	-	-	125	1,875
海爾電器集團有限公司	7,327	-	-	458	6,869
海通證券股份有限公司—H股	14,222	-	-	889	13,333
Hana Financial Group	1,977	-	-	303	1,674
Hanergy Thin Film Power Grou	75,143	-	-	18,000	57,143
Hankook Tire Co Ltd	376	-	-	24	352
Hanmi Pharm Co Ltd	31	-	-	2	29
Hanmi Science Co Ltd	-	63	-	4	59
Hanon Systems	-	419	-	26	393
Hanssem Co Ltd	-	37	-	2	35
Hanwha Chemical Corp	936	-	-	59	877
Hanwha Corporation	560	-	-	148	412
Hanwha Techwin Co Ltd	-	210	-	-	210
Hap Seng Consolidated	-	3,000	-	188	2,812
恒安國際集團有限公司	6,068	5,568	-	6,416	5,220
恒騰網絡集團有限公司	-	124,000	-	-	124,000
Hm Sampoerna TBK PT	-	700	16,800	1,094	16,406
Home Product Center PCL (FR)	37,036	-	-	2,315	34,721
鴻海精密工業股份有限公司	95,086	-	8,726	16,818	86,994
和泰汽車股份有限公司	2,940	-	-	1,184	1,756
Hotel Shilla Co Ltd	229	-	-	14	215
宏達國際電子股份有限公司	6,811	-	-	3,238	3,573

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
華南金融控股股份有限公司	-	10,000	620	-	10,620
華能國際電力股份有限公司—H股	23,928	-	-	1,496	22,432
華泰證券股份有限公司—H股	-	3,400	-	213	3,187
Hyosung Corporation	104	-	-	7	97
Hyundai Dept Store Co	128	-	-	8	120
Hyundai Development Co-Engin	327	-	-	-	327
Hyundai Engineering & Const	504	-	-	32	472
Hyundai Glovis Co Ltd	79	-	-	5	74
Hyundai Heavy Industries	361	-	-	67	294
Hyundai Marine & Fire Ins Co	368	-	-	-	368
Hyundai Mobis Co Ltd	512	-	-	93	419
Hyundai Motor Co	1,307	-	-	441	866
Hyundai Motor Co Ltd—第二優先股	-	42	-	-	42
Hyundai Steel Co	632	-	-	124	508
Hyundai Wia Corp	88	-	-	6	82
IHH Healthcare BHD	19,823	-	-	1,239	18,584
IJM Corp BHD	-	11,800	-	738	11,062
中國工商銀行—H股	474,773	-	-	60,798	413,975
Indocement Tunggal Prakarsa	6,000	-	-	375	5,625
Indofood Sukses Makmur TBK P	40,000	-	-	2,500	37,500
Indorama Ventures PCL (FR)	15,200	-	-	950	14,250
Industrial Bank of Korea	930	-	-	58	872
群創光電	54,993	-	-	3,437	51,556
華亞科技股份有限公司	13,156	-	-	13,156	-
Intl Container Term Svcs Inc	12,400	-	-	3,494	8,906
英業達股份有限公司	-	10,000	-	-	10,000
IOI Corp BHD	44,511	-	-	16,251	28,260
IOI Properties Group BHD	50,079	-	-	14,130	35,949
Jasa Marga (Persero) TBK PT	20,000	1,262	-	1,250	20,012
京東商城電子商務有限公司—ADR	1,122	3,068	-	262	3,928
JG Summit Holdings Inc	24,000	-	-	1,500	22,500
江蘇寧滬高速公路股份有限公司—H股	5,854	-	-	366	5,488
江西銅業股份有限公司—H股	9,632	-	-	602	9,030
Jollibee Foods Corp	5,680	-	-	355	5,325
Kakao Corp	184	-	-	12	172
Kalbe Farma TBK PT	147,607	-	-	9,225	138,382
Kangwon Land Inc	696	-	-	44	652
Kasikornbank PCL - Foreign	9,916	-	-	1,520	8,396
KB Financial Group Inc	2,456	-	-	248	2,208
KCC Corp	50	-	-	3	47
KCE Electronics - NVDR	-	1,600	-	1,600	-

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
KCE Electronics PCL (FR)	-	1,600	-	-	1,600
Kepeco Plant Service & Engine	-	94	-	-	94
KIA Motors Corp	1,905	-	-	245	1,660
金山軟件有限公司	4,000	-	-	250	3,750
Korea Aerospace Industries	216	110	-	14	312
Korea Electric Power Corp	1,654	-	-	225	1,429
Korea Investment Holdings Co	536	-	-	145	391
Korea Zinc Co Ltd	72	-	-	14	58
Korean Air Lines Co Ltd	459	-	-	29	430
Krung Thai Bank PCL (FR)	18,360	-	-	1,148	17,212
KT&G Corp	692	-	-	93	599
Kuala Lumpur Kepong BHD	2,934	-	-	183	2,751
Kumho Petrochemical Co Ltd	109	-	-	7	102
崑崙能源有限公司	22,400	-	-	1,400	21,000
大立光電股份有限公司	568	-	-	36	532
聯想集團有限公司	46,400	-	-	2,900	43,500
LG Chem Ltd	328	-	-	39	289
LG Chem Ltd—優先股	75	-	-	28	47
LG Corp	850	-	-	120	730
LG Display Co Ltd	1,840	-	-	292	1,548
LG Electronics Inc	1,005	-	-	386	619
LG Household & Health Care	64	-	-	9	55
LG Uplus Corp	1,174	-	-	73	1,101
Lippo Karawaci TBK PT	100,535	-	-	6,283	94,252
光寶科技股份有限公司	18,584	-	86	1,162	17,508
Lotte Chemical Corp	128	-	-	8	120
Lotte Confectionery Co Ltd	11	-	99	26	84
Lotte Shopping Co	80	-	-	5	75
Malayan Banking BHD	28,843	-	-	6,703	22,140
Matahari Department Store TB	22,609	-	-	4,601	18,008
Maxis BHD	-	7,100	-	444	6,656
Media Nusantara Citra TBK PT	31,729	-	-	1,983	29,746
聯發科技股份有限公司	10,499	-	-	1,594	8,905
兆豐金融控股股份有限公司	42,792	-	-	2,675	40,117
美利達工業股份有限公司	1,893	-	-	118	1,775
Metro Pacific Investments Co	-	24,400	-	-	24,400
Metropolitan Bank & Trust	6,280	-	-	393	5,887
微星科技股份有限公司	-	4,000	-	-	4,000
Minor International PCL	-	10,000	-	10,000	-
Minor International PCL (FR)	-	10,000	-	625	9,375

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Mirae Asset Daewoo Co Ltd (前稱 Daewoo Securities Co Ltd)	1,736	-	-	109	1,627
Mirae Asset Securities Co Lt	1,048	-	-	364	684
MISC BHD	-	2,200	-	-	2,200
南亞塑膠工業股份有限公司	41,610	-	-	14,413	27,197
Naver Corp	176	-	-	12	164
Ncsoft Corp	90	-	-	6	84
網易公司—ADR	259	222	-	30	451
新華人壽保險股份有限公司—H股	5,334	-	-	333	5,001
新東方教育科技集團—SP ADR	436	375	-	51	760
新世界中國地產有限公司	-	12,000	-	12,000	-
NH Investment & Securities C	1,680	-	-	105	1,575
億豐綜合工業股份有限公司	-	1,000	-	-	1,000
玖龍紙業(控股)有限公司	12,000	-	-	750	11,250
聯誼科技股份有限公司	1,778	-	-	111	1,667
浩鼎生技股份有限公司	-	1,000	-	63	937
OCI Co Ltd	120	-	-	8	112
Orion Corp	24	-	-	2	22
Pakuwon Jati TBK PT	-	135,900	-	-	135,900
和碩聯合科技股份有限公司	11,588	-	-	724	10,864
中國人民保險集團股份有限公司—H股	26,666	-	-	1,667	24,999
Perusahaan Gas Negara Perser	96,000	-	-	6,000	90,000
中國石油天然氣股份有限公司—H股	142,871	-	-	26,179	116,692
Petronas Chemicals Group BHD	4,444	7,600	-	753	11,291
Petronas Gas BHD	-	2,600	-	163	2,437
中國人民財產保險股份有限公司—H股	22,951	-	-	1,434	21,517
中國平安保險(集團)股份有限公司—H股	34,606	-	-	3,569	31,037
PLDT Inc(前稱 Philippine Long Distance Tel)	569	-	-	36	533
POSCO	463	-	-	65	398
寶成	28,000	-	-	7,375	20,625
統一超商股份有限公司	3,556	-	-	222	3,334
PTT Exploration & Production PCL (FR)	7,677	-	-	480	7,197
PTT Global Chemical PCL (FR)	13,560	-	-	848	12,712
PTT PCL (FR)	7,600	-	-	1,038	6,562
Public Bank Berhad	13,514	-	-	845	12,669
奇虎360科技有限公司—ADR	306	248	-	554	-
親親食品集團(開曼)股份有限公司	-	1,113	-	1,113	-
廣達電腦股份有限公司	12,000	-	-	750	11,250
Qunar Cayman Islands Ltd - ADR	174	85	-	16	243
瑞昱半導體股份有限公司	-	4,000	-	2,000	2,000

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
S-1 Corporation	-	70	-	4	66
Samsung Biologics Co Ltd	-	93	-	-	93
Samsung C&T Corp	536	-	-	70	466
Samsung Card Co	480	-	-	30	450
Samsung Electro-Mechanics Co	427	-	-	113	314
Samsung Electronics—優先股	136	-	-	34	102
Samsung Electronics Co Ltd	698	-	-	149	549
Samsung Fire & Marine Ins	279	-	-	41	238
Samsung Heavy Industries	498	289	-	31	756
Samsung Life Insurance Co Ltd	440	-	-	28	412
Samsung Sdi Co Ltd	377	-	-	64	313
Samsung Sds Co Ltd	205	-	-	13	192
Samsung Securities Co Ltd	394	-	-	25	369
Sapurakencana Petroleum BHD	30,180	-	-	1,886	28,294
Semen Indonesia Persero TBK	16,000	-	-	1,000	15,000
中芯國際集成電路製造有限公司	205,600	38,550	-	224,875	19,275
山東威高集團醫用高分子製品股份有限公司—H股	9,854	-	-	616	9,238
上海電氣集團總公司—H股	-	10,000	-	-	10,000
上海復星醫藥(集團)股份有限公司—H股	2,000	-	-	125	1,875
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司—B股	2,071	-	1,657	-	3,728
上海醫藥集團股份有限公司—H股	4,792	-	-	300	4,492
申洲國際集團	3,786	-	-	237	3,549
世茂房地產控股有限公司	16,000	-	-	5,219	10,781
Shinhan Financial Group Ltd	2,705	-	-	391	2,314
Shinsegae Inc	105	-	-	29	76
瑞安房地產有限公司	68,261	-	-	68,261	-
Siam Cement Pub Co (FR)	1,854	-	-	116	1,738
Siam Commercial Bank PCL (FR)	10,550	-	-	659	9,891
矽品精密工業股份有限公司	12,737	12,737	-	13,533	11,941
Sime Darby Berhad	28,736	-	-	10,796	17,940
新浪公司	-	320	-	-	320
中國生物製藥有限公司	28,728	-	-	1,796	26,932
遠洋集團控股有限公司(前稱遠洋地產控股有限公司)	-	-	-	1,393	20,888
永豐金融控股股份有限公司	39,806	-	1,865	2,488	39,183
中國石化上海石油化工股份有限公司—H股	35,577	-	-	2,224	33,353
國藥控股股份有限公司—H股	7,240	-	-	453	6,787
中國外運股份有限公司—H股	12,800	-	-	800	12,000
SK Holdings Co Ltd	270	-	-	17	253
SK Hynix Inc	3,976	-	-	587	3,389
SK Innovation Co Ltd	564	-	-	130	434

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
SK Telecom	-	83	-	5	78
SM Investments Corp	1,469	-	688	1,222	935
SM Prime Holdings Inc	44,800	-	-	2,800	42,000
Soho中國有限公司	15,107	-	-	944	14,163
S-Oil Corp	200	-	-	13	187
舜宇光學科技(集團)有限公司	-	4,000	-	-	4,000
Surya Citra Media PT TBK	31,304	-	-	1,957	29,347
聯強國際股份有限公司	12,000	-	562	750	11,812
中裕新藥股份有限公司	-	1,000	-	63	937
台新金融控股股份有限公司	27,864	-	1,890	1,742	28,012
台灣中小企業銀行股份有限公司	66,777	-	3,130	4,174	65,733
台灣水泥股份有限公司	45,879	-	-	17,367	28,512
合作金庫金融控股股份有限公司	44,444	-	2,916	2,778	44,582
台灣肥料股份有限公司	-	4,000	-	-	4,000
台灣大哥大股份有限公司	15,600	-	-	5,975	9,625
台灣積體電路製造股份有限公司	158,115	-	-	20,695	137,420
好未來教育集團-ADR	137	120	-	16	241
東元電機股份有限公司	-	4,000	-	-	4,000
Telekomunikasi Indonesia Per	406,880	-	-	84,399	322,481
Tenaga Nasional BHD	22,920	-	-	3,533	19,387
騰訊控股有限公司	33,404	1,500	-	4,032	30,872
Thai Oil PCL	-	2,200	-	2,200	-
Thai Oil PCL (FR)	-	2,200	-	138	2,062
康師傅控股有限公司	15,368	-	-	961	14,407
Tower Bersama Infrastructure	16,696	-	-	1,044	15,652
中國民航信息網絡股份有限公司-H股	-	3,000	-	188	2,812
True Corp PCL (FR)	87,385	-	1,310	38,450	50,245
青島啤酒股份有限公司-H股	3,032	-	-	190	2,842
Unilever Indonesia TBK PT	12,000	-	-	3,281	8,719
統一企業股份有限公司	37,830	-	-	10,364	27,466
聯華電子股份有限公司	130,266	-	-	41,454	88,812
United Tractors TBK PT	8,000	-	-	500	7,500
Universal Robina Corp	8,000	-	-	500	7,500
世界先進積體電路股份有限公司	1,778	-	-	111	1,667
唯品會控股有限公司-ADR	1,303	1,144	-	153	2,294
中國旺旺控股有限公司	40,568	-	-	2,536	38,032
新浪微博-Spon ADR	-	181	-	-	181
緯創資通股份有限公司	-	7,000	196	438	6,758
Woori Bank	2,481	-	-	619	1,862
大聯大投資控股股份有限公司	-	3,000	-	-	3,000
Youku Tudou Inc - ADR	392	-	-	392	-

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
YTL Corp BHD	-	15,800	-	988	14,812
元大金融控股股份有限公司	129,248	-	-	40,266	88,982
Yuhan Corp	38	-	1	2	37
百勝中國控股有限公司	-	2,321	-	-	2,321
歡聚時代-ADR	96	82	-	11	167
浙江滬杭甬高速公路股份有限公司-H股	7,786	-	-	487	7,299
株洲南車時代電氣股份有限公司-H股	5,334	-	-	1,740	3,594
紫金礦業集團股份有限公司-H股	56,888	-	-	18,556	38,332
中興通訊股份有限公司-H股	2,496	-	-	156	2,340
<b>交易所買賣基金</b>					
iShares安碩亞洲信託基金-iShares安碩標普BSE Sensex印度指數ETF	819,568	46,000	-	66,411	799,157
<b>上市供股權</b>					
BNK Financial Group Inc-供股權	336	-	-	336	-
華潤啤酒(控股)有限公司-供股權	-	-	2,764	2,764	-
保利協鑫能源控股有限公司-供股權	12,334	-	-	12,334	-
Jasa Marga (Persero) TBK PT-供股權	-	-	1,262	1,262	-
Samsung Heavy Industries-供股權	-	-	289	289	-
True Corp PCL-供股權	-	29,799	29,799	59,598	-
<b>上市認股權證</b>					
Indorama Ventures PCL-認股權證	3,361	-	-	3,361	-
<b>非上市供股權</b>					
國泰金融控股股份有限公司-供股權	-	-	6,114	3,057	3,057
Eclat Textile Company Ltd-供股權	-	-	37	37	-
富邦金融控股股份有限公司-供股權	-	-	3,076	3,076	-
Hanwha Corporation-供股權	-	-	106	106	-
台新金融控股股份有限公司-供股權	-	-	2,126	1,063	1,063

# iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 港元	成分基金交易 資產淨值 港元
截至下列日期財務期間結束時		
二零一四年十二月三十一日	43.97	158,280,131
二零一五年十二月三十一日	38.29	122,524,427
二零一六年十二月三十一日	39.75	119,250,293

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 港元	最低每單位 資產淨值 港元
截至下列日期止財務期間		
二零零九年十二月三十一日(自成立以來)	38.30	20.00
二零一零年十二月三十一日	45.33	33.63
二零一一年十二月三十一日	47.81	34.56
二零一二年十二月三十一日	43.99	36.30
二零一三年十二月三十一日	44.41	37.56
二零一四年十二月三十一日	48.00	39.33
二零一五年十二月三十一日	50.31	36.60
二零一六年十二月三十一日	44.18	33.70

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)</b>			
<b>上市股本</b>			
中國農業銀行—A股	22,100	76,598	0.04
愛爾眼科醫院集團股份有限公司—A股	7,400	247,383	0.13
中國國際航空股份有限公司—A股	50,400	405,723	0.21
航天信息股份有限公司—A股	21,100	470,643	0.24
中國鋁業股份有限公司—A股	33,500	158,060	0.08
北極光光電有限公司—A股	4,200	126,553	0.07
中航飛機股份有限公司—A股	26,000	618,020	0.32
中航投資控股股份有限公司—A股	33,200	227,172	0.12
中航直升機有限責任公司—A股	4,200	227,374	0.12
交通銀行股份有限公司—A股	93,500	603,189	0.31
南京銀行股份有限公司—A股	9,500	115,138	0.06
北京首創股份有限公司—A股	47,500	218,274	0.11
北京大北農科技集團股份有限公司—A股	40,400	320,705	0.17
北京光線傳媒股份有限公司—A股	16,900	184,418	0.10
北京捷成世紀科技股份有限公司—A股	15,500	178,672	0.09
北京東方園林股份有限公司—A股	20,600	325,904	0.17
北京碧水源科技股份有限公司—A股	32,800	642,501	0.33
北京三聚環保新材料股份有限公司—A股	10,200	527,902	0.27
北京中長石基信息技術股份有限公司—A股	5,200	141,685	0.07
北京信威科技集團股份有限公司—A股 (前稱北京信威通信技術股份有限公司—A股)	27,300	445,637	0.23
北京藍色光標品牌管理顧問股份有限公司—A股	27,400	311,557	0.16
比亞迪股份有限公司—A股	6,700	372,154	0.19
湯臣倍健股份有限公司—A股	17,100	228,279	0.12
中航航空電子系統股份有限公司—A股	7,900	163,935	0.08
中國船舶工業股份有限公司—A股	13,600	419,828	0.22
華夏幸福基業投資開發股份有限公司—A股	17,500	467,630	0.24
中國葛洲壩集團股份有限公司—A股	53,100	545,602	0.28
廣匯汽車服務股份公司—A股	26,200	250,750	0.13
神州高鐵技術股份有限公司—A股	11,300	117,750	0.06
中國核工業建設集團公司—A股	7,600	146,068	0.08
中國鐵建股份有限公司—A股	14,300	191,220	0.10
中國中鐵股份有限公司—A股	34,200	338,786	0.18
中安消股份有限公司—A股	12,100	235,803	0.12
中國船舶重工股份有限公司—A股	166,700	1,321,442	0.68
中國船舶重工集團動力股份有限公司—A股	5,400	184,386	0.10
中國南方航空股份有限公司—A股	67,000	525,870	0.27
中國東方紅衛星股份有限公司—A股	1,600	55,885	0.03
中國建築—A股	6,600	65,380	0.03
中國聯合網絡—A股	162,100	1,324,849	0.68

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
<b>上市股本(續)</b>			
中國長江電力股份有限公司—A股	5,300	75,020	0.04
中文天地出版傳媒股份有限公司—A股	10,800	243,917	0.13
重慶長安汽車股份有限公司—A股	5,300	88,530	0.05
中遠海運發展股份有限公司—A股(前稱中海集裝箱運輸股份有限公司—A股)	60,700	276,895	0.14
中國中車股份有限公司—A股	79,500	868,416	0.45
中船海洋與防務裝備股份有限公司—A股	1,900	63,092	0.03
大秦鐵路股份有限公司—A股	114,900	909,535	0.47
東華軟體股份公司—A股	7,100	184,961	0.10
神州數碼信息服務股份有限公司—A股	3,800	90,199	0.05
東阿阿膠股份有限公司—A股	9,700	584,231	0.30
東方電氣股份有限公司—A股	12,400	149,592	0.08
鵬博士電信傳媒集團股份有限公司—A股	20,000	490,382	0.25
深圳市怡亞通供應鏈股份有限公司—A股	4,400	53,425	0.03
光大證券股份有限公司—A股	12,600	225,261	0.12
一汽轎車股份有限公司—A股	13,500	164,070	0.08
烽火通信科技股份有限公司—A股	10,300	290,319	0.15
第一創業證券股份有限公司—A股	3,500	136,180	0.07
福建聖農發展股份有限公司—A股	6,600	156,587	0.08
新城控股集團股份有限公司—A股	13,200	173,412	0.09
廣發證券股份有限公司—A股	35,000	659,769	0.34
綠地控股集團股份有限公司—A股	33,800	329,155	0.17
廣深鐵路股份有限公司—A股	64,000	362,789	0.19
廣西梧州中恒集團股份有限公司—A股	49,200	251,940	0.13
廣州海格通信集團股份有限公司—A股	4,800	62,522	0.03
國軒高科股份有限公司	7,200	249,471	0.13
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	5,300	141,092	0.07
河南雙匯投資發展股份有限公司—A股	19,500	456,320	0.24
河鋼集團有限公司—A股 (前稱河北鋼鐵集團有限公司—A股)	16,100	60,123	0.03
浙江核新同花順網絡信息股份有限公司—A股	3,400	261,461	0.14
華蘭生物工程股份有限公司—A股	10,300	411,699	0.21
華聞傳媒投資集團股份有限公司—A股	24,900	314,311	0.16
華誼兄弟傳媒股份有限公司—A股	31,200	383,719	0.20
華域汽車系統股份有限公司—A股	18,900	337,046	0.17
湖北百科藥業股份有限公司—A股	19,000	162,510	0.08
恒生電子股份有限公司—A股	9,400	495,431	0.26
興業銀行股份有限公司—A股	8,600	155,192	0.08
內蒙古君正能源化工股份有限公司—A股	10,200	53,030	0.03
內蒙古伊利實業集團股份有限公司—A股	113,000	2,223,603	1.15

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
<b>上市股本(續)</b>			
江蘇省廣電有線信息網絡股份有限公司—A股	10,600	133,922	0.07
江蘇恒瑞醫藥股份有限公司—A股	27,200	1,383,714	0.71
吉林敖東藥業集團股份有限公司—A股	14,100	488,548	0.25
康美藥業股份有限公司—A股	56,700	1,131,586	0.58
貴州茅台酒股份有限公司—A股	9,400	3,511,846	1.81
利歐集團股份有限公司—A股	9,800	174,764	0.09
遼寧成大股份有限公司—A股	24,100	483,938	0.25
魯信創業投資集團—A股	4,200	106,220	0.05
瀘州老窖股份有限公司—A股	13,800	509,166	0.26
中國冶金科工股份有限公司—A股	84,500	440,260	0.23
美的集團股份有限公司—A股	3,800	119,684	0.06
牧原食品股份有限公司—A股	6,100	158,774	0.08
東方證券股份有限公司—A股	6,300	109,390	0.06
太平洋證券股份有限公司—A股	9,300	53,550	0.03
龐大汽貿集團股份有限公司—A股	24,400	75,568	0.04
平安銀行股份有限公司—A股	23,500	239,098	0.12
上海汽車集團股份有限公司—A股	59,900	1,570,492	0.81
三一重工股份有限公司—A股	36,300	247,573	0.13
國投電力控股股份有限公司—A股	23,400	174,505	0.09
國海證券股份有限公司—A股	41,800	325,743	0.17
上海建工集團股份有限公司—A股	60,000	317,306	0.16
上海復星醫藥(集團)股份有限公司—A股	18,793	486,212	0.25
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	42,300	242,146	0.13
上海錦江國際酒店(集團)股份有限公司—A股	1,800	59,289	0.03
上海東方明珠新媒體股份有限公司—A股	7,800	203,197	0.10
上海隧道工程股份有限公司—A股	5,200	64,011	0.03
上海外高橋保稅區開發股份有限公司—A股	4,300	94,903	0.05
山西證券股份有限公司—A股	5,000	67,196	0.03
山西西山煤電股份有限公司—A股	25,000	236,470	0.12
深圳市匯川技術股份有限公司—A股	18,700	425,055	0.22
深圳歐菲光科技股份有限公司—A股	1,500	57,491	0.03
深圳華僑城股份有限公司—A股	7,000	54,394	0.03
深圳市中金嶺南有色金屬股份有限公司—A股	3,800	47,372	0.02
新松機器人自動化股份有限公司—A股	21,000	501,988	0.26
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	4,500	57,608	0.03
蘇寧環球股份有限公司—A股	18,600	179,469	0.09
陽光城集團股份有限公司—A股	23,900	148,840	0.08
蘇州勝利精密製造科技股份有限公司—A股	27,400	253,351	0.13
特變電工股份有限公司—A股	60,600	618,599	0.32
天齊鋰業股份有限公司—A股	10,200	370,068	0.19

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
<b>上市股本(續)</b>			
清華同方股份有限公司—A股	32,900	509,462	0.26
清華紫光股份有限公司—A股	2,100	134,748	0.07
紫光國芯股份有限公司—A股	5,600	206,242	0.11
萬達電影院線股份有限公司—A股	900	54,408	0.03
網宿科技股份有限公司—A股	9,000	539,454	0.28
萬向錢潮股份有限公司—A股	19,400	287,615	0.15
華數傳媒控股股份有限公司—A股	2,800	56,069	0.03
濰柴動力股份有限公司—A股	45,600	507,797	0.26
永泰能源股份有限公司—A股	43,500	195,029	0.10
萬達信息股份有限公司—A股	2,200	49,736	0.03
宜賓五糧液股份有限公司—A股	35,300	1,360,843	0.70
徐工集團工程機械股份有限公司—A股	68,500	258,865	0.13
廈門建發股份有限公司—A股	28,500	340,953	0.18
新疆金風科技股份有限公司—A股	29,400	562,423	0.29
用友網絡科技股份有限公司—A股	2,400	55,867	0.03
遊族網絡股份有限公司—A股	5,000	147,864	0.08
浙江正泰電器股份有限公司—A股	7,900	176,654	0.09
浙江華策影視股份有限公司—A股	13,800	175,122	0.09
浙江萬豐奧威汽輪股份有限公司—A股	14,800	326,975	0.17
浙江浙能電力股份有限公司—A股	18,800	114,136	0.06
中聯重科股份有限公司—A股	85,200	432,476	0.22
中興通訊股份有限公司—A股	42,600	759,690	0.39
總上市股本		49,299,666	25.45

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
<b>由Credit Suisse AG, Nassau Branch發行的 上市CAAP·持有下列公司股份</b>			
中國農業銀行—A股	458,429	1,588,912	0.82
奧飛娛樂股份有限公司—A股 (前稱廣東奧飛動漫文化股份有限公司—A股)	10,586	268,673	0.14
中國鋁業股份有限公司—A股	86,505	408,150	0.21
安徽海螺水泥股份有限公司—A股	40,221	762,684	0.39
中航動力控制股份有限公司—A股	5,692	157,446	0.08
中航投資控股股份有限公司—A股	47,244	323,269	0.17
北京銀行股份有限公司—A股	230,367	2,513,831	1.30
中國銀行股份有限公司—A股	383,506	1,475,017	0.76
交通銀行股份有限公司—A股	426,778	2,753,240	1.42
南京銀行股份有限公司—A股	55,481	672,418	0.35
寧波銀行股份有限公司—A股	39,204	729,373	0.38
寶山鋼鐵股份有限公司—A股	99,323	705,163	0.36
北京神州泰岳軟件股份有限公司—A股	22,416	231,577	0.12
京東方科技集團股份有限公司—A股	168,879	540,018	0.28
比亞迪股份有限公司—A股	2,629	146,029	0.08
長江證券股份有限公司—A股	66,702	762,923	0.39
中國寶安集團股份有限公司—A股	41,205	477,283	0.25
中信銀行股份有限公司—A股	58,930	422,339	0.22
中國交通建設股份有限公司—A股	30,789	522,901	0.27
中國建設銀行股份有限公司—A股	127,166	773,457	0.40
中國東方航空股份有限公司—A股	13,092	103,488	0.05
中國光大銀行股份有限公司—A股	301,530	1,318,176	0.68
海南天然橡膠產業集團股份有限公司—A股	7,396	57,554	0.03
中國國旅股份有限公司—A股	9,320	452,243	0.23
中國國際海運集裝箱(集團)股份有限公司—A股	14,758	241,235	0.12
中國人壽保險股份有限公司—A股	33,181	893,701	0.46
招商銀行—A股	195,336	3,843,803	1.98
招商證券股份有限公司—A股	43,877	801,105	0.41
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	46,004	843,025	0.44
中國民生銀行—A股	447,670	4,544,749	2.35
中國北方稀土(集團)高科技股份有限公司—A股	43,821	601,164	0.31
中國太平洋保險(集團)股份有限公司—A股	59,525	1,848,168	0.95
中國石油化工股份有限公司—A股	205,604	1,243,641	0.64
中國中鐵股份有限公司—A股	108,316	1,072,982	0.55
中國神華能源股份有限公司—A股	37,587	679,958	0.35
萬科企業股份有限公司—A股	128,868	2,960,895	1.53
重慶長安汽車股份有限公司—A股	31,625	528,259	0.27
中信證券股份有限公司—A股	149,055	2,676,444	1.38

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
<b>由Credit Suisse AG, Nassau Branch發行的 上市CAAP·持有下列公司股份(續)</b>			
中遠海運控股股份有限公司—A股 (前稱中國遠洋控股股份有限公司—A股)	70,646	413,890	0.21
中國中車股份有限公司—A股	92,286	1,008,084	0.52
東華軟體股份公司—A股	10,552	274,889	0.14
東方電氣股份有限公司—A股	11,176	134,826	0.07
東旭光電科技股份有限公司—A股	13,574	170,888	0.09
東方財富信息股份有限公司—A股	39,220	742,387	0.38
光大證券股份有限公司—A股	21,564	385,517	0.20
一汽轎車股份有限公司—A股	2,420	29,411	0.02
金融街控股股份有限公司—A股	22,592	260,171	0.13
福耀玻璃工業集團股份有限公司—A股	4,152	86,484	0.05
金地(集團)股份有限公司—A股	45,132	653,967	0.34
廣發證券股份有限公司—A股	18,325	345,436	0.18
珠海格力電器股份有限公司—A股	91,140	2,508,784	1.30
廣東錦龍發展股份有限公司—A股	8,454	221,557	0.11
廣匯能源股份有限公司—A股	62,981	328,846	0.17
廣州海格通信集團股份有限公司—A股	28,684	373,621	0.19
國信證券股份有限公司—A股	45,716	794,813	0.41
國元證券股份有限公司—A股	24,198	538,392	0.28
海南航空股份有限公司—A股	88,718	323,367	0.17
海通證券股份有限公司—A股	153,186	2,697,527	1.39
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	27,815	740,465	0.38
大族激光科技產業集團股份有限公司—A股	16,973	428,877	0.22
河鋼集團有限公司—A股 (前稱河北鋼鐵集團有限公司—A股)	73,055	272,811	0.14
華泰證券股份有限公司—A股	34,850	695,906	0.36
華聞傳媒投資集團股份有限公司—A股	11,202	141,402	0.07
華夏銀行股份有限公司—A股	103,765	1,258,771	0.65
華域汽車系統股份有限公司—A股	2,746	48,970	0.03
湖南電廣傳媒股份有限公司—A股	22,608	363,738	0.19
科大訊飛股份有限公司—A股	18,135	549,279	0.28
中國工商銀行—A股	408,419	2,013,772	1.04
興業銀行股份有限公司—A股	239,523	4,322,319	2.23
興業證券股份有限公司—A股	89,868	768,657	0.40
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司—A股	194,959	608,154	0.31
內蒙古君正能源化工股份有限公司—A股	44,376	230,711	0.12
江西銅業股份有限公司—A股	15,464	289,257	0.15
金堆城鎢業股份有限公司—A股	19,429	166,180	0.09

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
<b>由Credit Suisse AG, Nassau Branch發行的 上市CAAP·持有下列公司股份(續)</b>			
康得新複合材料集團股份有限公司—A股 (前稱江蘇康得新複合材料股份有限公司—A股)	48,169	1,029,187	0.53
金正大生態工程集團股份有限公司—A股	30,316	267,772	0.14
樂視網信息技術(北京)股份有限公司—A股	18,354	734,649	0.38
立訊精密工業股份有限公司—A股	16,445	381,521	0.20
梅花生物科技集團股份有限公司—A股	37,647	274,438	0.14
美的集團股份有限公司—A股	79,922	2,517,209	1.30
國電南瑞科技股份有限公司—A股	24,150	449,030	0.23
新華人壽保險股份有限公司—A股	16,032	784,747	0.41
新希望六和股份有限公司—A股	24,372	219,358	0.11
東北證券股份有限公司—A股	28,276	390,753	0.20
海洋石油工程股份有限公司—A股	44,429	366,597	0.19
東方證券股份有限公司—A股	50,592	878,455	0.45
太平洋證券股份有限公司—A股	80,544	463,774	0.24
龐大汽質集團股份有限公司—A股	54,472	168,702	0.09
人民網股份有限公司—A股	11,752	232,043	0.12
中國石油天然氣股份有限公司—A股	97,629	867,785	0.45
平安銀行股份有限公司—A股	133,393	1,357,189	0.70
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	201,160	7,968,542	4.11
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	134,736	1,375,373	0.71
中國電力建設集團有限公司—A股	54,545	442,749	0.23
青島海爾股份有限公司—A股	60,400	667,206	0.34
青海鹽湖工業股份有限公司—A股	14,427	307,605	0.16
榮盛房地產發展股份有限公司—A股	24,988	219,314	0.11
三一重工股份有限公司—A股	27,715	189,021	0.10
國投電力控股股份有限公司—A股	51,606	384,851	0.20
國海證券股份有限公司—A股	7,346	57,247	0.03
海虹企業(控股)股份有限公司—A股	14,471	680,347	0.35
陝西煤業股份有限公司—A股	40,199	217,983	0.11
山東黃金礦業股份有限公司—A股	14,055	573,732	0.30
上海電氣集團總公司—A股	10,554	104,958	0.05
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	21,632	123,832	0.06
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司—A股	14,302	353,870	0.18
上海東方明珠新媒體股份有限公司—A股	17,132	446,303	0.23
上海浦東發展銀行—A股	163,690	2,966,684	1.53
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	20,404	526,751	0.27
上海城投控股股份有限公司—A股	29,771	677,034	0.35
上海外高橋保稅區開發股份有限公司—A股	3,960	87,399	0.05

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
<b>由Credit Suisse AG, Nassau Branch發行的 上市CAAP：持有下列公司股份(續)</b>			
山西證券股份有限公司－A股	14,503	194,907	0.10
申萬宏源集團股份有限公司－A股	120,923	844,997	0.44
深圳能源集團股份有限公司－A股	24,001	184,354	0.10
深圳歐菲光科技股份有限公司－A股	12,198	467,515	0.24
深圳華僑城股份有限公司－A股	54,320	422,096	0.22
深圳市中金嶺南有色金屬股份有限公司－A股	27,388	341,430	0.18
四川長虹電器股份有限公司－A股	73,613	344,031	0.18
國金證券股份有限公司－A股	36,194	527,287	0.27
中國石化上海石油化工股份有限公司－A股	41,215	296,761	0.15
東吳證券股份有限公司－A股	25,709	381,437	0.20
西南證券股份有限公司－A股	54,972	438,225	0.23
春秋航空股份有限公司－A股	4,400	180,742	0.09
蘇寧雲商集團股份有限公司－A股	66,173	847,134	0.44
蘇州金螳螂建築裝飾股份有限公司－A股	30,949	338,763	0.18
TCL集團股份有限公司－A股	128,302	473,384	0.24
天津中環半導體股份有限公司－A股	11,759	108,728	0.06
通化東寶藥業股份有限公司－A股	18,259	447,694	0.23
銅陵有色金屬集團股份有限公司－A股	132,437	456,064	0.24
啟迪桑德環境資源股份有限公司－A股	9,709	358,007	0.19
萬華化學集團股份有限公司－A股	20,753	499,564	0.26
西部證券股份有限公司－A股	27,328	634,615	0.33
永泰能源股份有限公司－A股	42,602	191,003	0.10
武漢鋼鐵股份有限公司－A股	76,008	289,788	0.15
徐工集團工程機械股份有限公司－A股	10,018	37,859	0.02
新湖中寶股份有限公司－A股	67,376	313,375	0.16
新興鑄管股份有限公司－A股	43,548	251,724	0.13
兗州煤業股份有限公司－A股	8,407	102,079	0.05
永輝超市股份有限公司－A股	82,248	451,516	0.23
雅戈爾集團股份有限公司－A股	29,893	467,243	0.24
浙江中國小商品城集團股份有限公司－A股	54,221	524,385	0.27
浙江大華技術股份有限公司－A股	28,587	437,241	0.23
浙江龍盛集團股份有限公司－A股	45,749	471,094	0.24
浙江浙能電力股份有限公司－A股	36,076	219,020	0.11
鄭州宇通客車股份有限公司－A股	26,458	579,505	0.30
中金黃金股份有限公司－A股	33,898	458,212	0.24
紫金礦業集團股份有限公司－A股	190,557	711,602	0.37
		110,184,810	56.89

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
<b>由HSBC Bank plc發行的上市CAAP， 持有下列公司股份</b>			
安信信託股份有限公司－A股	17,000	448,947	0.23
北極光光電有限公司－A股	4,400	132,580	0.07
北京首都開發股份有限公司－A股	21,500	283,893	0.15
北京歌華有線電視網絡股份有限公司－A股	13,400	229,525	0.12
渤海金控投資股份有限公司－A股 (前稱渤海租賃股份有限公司－A股)	35,360	282,673	0.15
招商局能源運輸股份有限公司－A股	42,240	233,301	0.12
中國核能電力股份有限公司－A股	93,120	735,045	0.38
中國鐵建股份有限公司－A股	68,764	919,514	0.47
中國建築－A股	277,392	2,747,854	1.42
中國長江電力股份有限公司－A股	119,672	1,693,918	0.87
中信國安信息產業股份有限公司－A股	52,750	541,416	0.28
中信重工機械股份有限公司－A股	24,560	154,048	0.08
中糧屯河股份有限公司－A股	19,700	274,442	0.14
中船海洋與防務裝備股份有限公司－A股	4,700	156,070	0.08
東興證券股份有限公司－A股	21,700	486,695	0.25
深圳市怡亞通供應鏈股份有限公司－A股	24,200	293,840	0.15
分眾傳媒信息技術股份有限公司－A股	11,800	188,266	0.10
福耀玻璃工業集團股份有限公司－A股	24,400	508,240	0.26
國電電力發展股份有限公司－A股	226,340	802,208	0.41
綠地控股集團股份有限公司－A股	6,700	65,247	0.03
廣州廣電運通金融電子股份有限公司－A股	15,500	230,142	0.12
貴州百靈企業集團製藥股份有限公司－A股	8,100	171,526	0.09
國泰君安證券股份有限公司－A股	83,900	1,743,843	0.90
浪潮電子信息產業股份有限公司－A股	11,500	272,584	0.14
江蘇省廣電有線信息網絡股份有限公司－A股	15,496	195,778	0.10
江蘇保千里視像科技集團股份有限公司－A股	17,700	262,016	0.14
際華集團股份有限公司－A股	30,720	316,335	0.16
上海吉祥航空股份有限公司－A股	2,720	70,858	0.04
北京掌趣科技股份有限公司－A股	37,320	385,549	0.20
國投安信股份有限公司－A股	21,300	371,748	0.19
上海二三四五網絡控股集團股份有限公司－A股	16,100	203,769	0.11
上海百潤投資控股集團股份有限公司－A股	2,900	65,626	0.03
上海電力股份有限公司－A股	17,040	231,289	0.12
上海國際機場股份有限公司－A股	19,220	569,893	0.29
上海隧道工程股份有限公司－A股	31,360	386,037	0.20
上海張江高科技園區開發股份有限公司－A股	15,440	305,898	0.16
深圳市銀之傑科技股份有限公司－A股	5,200	121,511	0.06
深圳市金證科技股份有限公司－A股	9,600	269,730	0.14

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
由HSBC Bank plc發行的上市CAAP， 持有下列公司股份(續)			
四川川投能源股份有限公司—A股	43,914	427,158	0.22
中石化石油工程技術服務有限公司—A股	35,100	160,901	0.08
宋城演藝發展股份有限公司—A股	11,440	267,836	0.14
天地科技股份有限公司—A股	31,800	176,705	0.09
萬達電影院線股份有限公司—A股	7,980	482,420	0.25
萬達信息股份有限公司—A股	10,800	244,158	0.13
物產中大集團股份有限公司—A股	22,100	255,246	0.13
中天城投集團股份有限公司—A股	54,020	418,556	0.22
		<hr/>	
		19,784,834	10.21

CAAP—中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
<b>由UBS AG London Branch 發行的上市CAAP， 持有下列公司股份</b>			
中國農業銀行－A股	243,300	843,276	0.44
中航動力控制股份有限公司－A股	3,538	97,864	0.05
中航動力股份有限公司－A股	15,524	568,262	0.29
北京同仁堂股份有限公司－A股	10,552	370,215	0.19
北京神州泰岳軟件股份有限公司－A股	1,524	15,744	0.01
京東方科技集團股份有限公司－A股	281,077	898,788	0.46
中國東方航空股份有限公司－A股	42,636	337,025	0.17
海南天然橡膠產業集團股份有限公司－A股	16,100	125,286	0.07
洛陽藥川鉬業集團股份有限公司－A股	74,564	310,126	0.16
中國東方紅衛星股份有限公司－A股	10,637	371,532	0.19
中遠海運控股股份有限公司－A股 (前稱中國遠洋控股股份有限公司－A股)	3,969	23,253	0.01
東旭光電科技股份有限公司－A股	23,371	294,227	0.15
東方財富信息股份有限公司－A股	2,824	53,455	0.03
光大證券股份有限公司－A股	1,785	31,912	0.02
方正證券股份有限公司－A股	80,484	683,894	0.35
歌爾聲學股份有限公司－A股	18,493	548,336	0.28
長城汽車股份有限公司－A股	24,049	297,384	0.15
廣東錦龍發展股份有限公司－A股	531	13,916	0.01
廣州白雲山醫藥集團股份有限公司－A股	10,609	284,439	0.15
國信證券股份有限公司－A股	1,624	28,235	0.02
海南航空股份有限公司－A股	42,400	154,543	0.08
青島海信電器股份有限公司－A股	15,853	303,446	0.16
華東醫藥股份有限公司－A股	4,490	361,799	0.19
華泰證券股份有限公司－A股	28,519	569,484	0.29
江蘇鳳凰出版傳媒股份有限公司－A股	15,204	177,980	0.09
江蘇洋河酒廠股份有限公司－A股	12,016	948,486	0.49
樂視網信息技術(北京)股份有限公司－A股	1,231	49,273	0.03
國電南瑞科技股份有限公司－A股	4,936	91,777	0.05
東軟集團股份有限公司－A股	19,099	419,817	0.22
新希望六和股份有限公司－A股	15,546	139,920	0.07
寧波舟山港股份有限公司－A股 (前稱寧波港股份有限公司－A股)	75,636	427,903	0.22
東方證券股份有限公司－A股	1,338	23,232	0.01
太平洋證券股份有限公司－A股	34,697	199,786	0.10
中國電力建設集團有限公司－A股	27,678	224,666	0.12
三安光電股份有限公司－A股	40,504	606,380	0.31
上海百聯集團股份有限公司－A股	13,685	219,718	0.11
上海醫藥集團股份有限公司－A股	22,028	481,737	0.25

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.36%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>中國(99.36%)(續)</b>			
由UBS AG London Branch發行的上市CAAP， 持有下列公司股份(續)			
山西證券股份有限公司－A股	1,303	17,511	0.01
深圳市農產品股份有限公司－A股	12,877	178,095	0.09
東吳證券股份有限公司－A股	14,564	216,082	0.11
春秋航空股份有限公司－A股	400	16,431	0.01
天士力製藥集團股份有限公司－A股	12,938	600,173	0.31
華數傳媒控股股份有限公司－A股	8,273	165,663	0.09
武漢鋼鐵股份有限公司－A股	5,162	19,681	0.01
用友網絡科技股份有限公司－A股	11,008	256,245	0.13
浙江浙能電力股份有限公司－A股	20,598	125,052	0.06
		13,192,049	6.81
<b>CAAP總額</b>		143,161,693	73.91
投資總額		192,461,359	99.36
其他資產淨值		1,231,775	0.64
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		193,693,134	100.00
投資總額(按成本)		202,818,484	

CAAP－中國A股連接產品，即與A股掛鈎的證券(例如認股權證、票據或參與證書)。

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
中國農業銀行—A股	-	22,100	-	-	22,100
愛爾眼科醫院集團股份有限公司—A股	-	7,400	-	-	7,400
中國國際航空股份有限公司—A股	-	50,400	-	-	50,400
航天信息股份有限公司—A股	-	21,100	-	-	21,100
中國鋁業股份有限公司—A股	-	33,500	-	-	33,500
鞍鋼股份有限公司—A股	-	31,400	-	31,400	-
北極光光電有限公司—A股	-	4,200	-	-	4,200
中航飛機股份有限公司—A股	-	26,000	-	-	26,000
中航投資控股股份有限公司—A股	-	33,200	-	-	33,200
中航直升機有限責任公司—A股	-	4,200	-	-	4,200
交通銀行股份有限公司—A股	-	93,500	-	-	93,500
南京銀行股份有限公司—A股	-	9,500	-	-	9,500
北京首創股份有限公司—A股	-	47,500	-	-	47,500
北京大北農科技集團股份有限公司—A股	-	40,400	-	-	40,400
北京光線傳媒股份有限公司—A股	-	16,900	-	-	16,900
北京捷成世紀科技股份有限公司—A股	-	15,500	-	-	15,500
北京京能電力股份有限公司—A股	-	22,100	-	22,100	-
北京東方園林股份有限公司—A股	-	20,600	-	-	20,600
北京碧水源科技股份有限公司—A股	-	32,800	-	-	32,800
北京三聚環保新材料股份有限公司—A股	-	10,200	-	-	10,200
北京中長石基信息技術股份有限公司—A股	-	7,900	-	2,700	5,200
北京信威科技集團股份有限公司—A股 (前稱北京信威通信技術股份有限公司—A股)	-	27,300	-	-	27,300
北京藍色光標品牌管理顧問股份有限公司—A股	-	27,400	-	-	27,400
比亞迪股份有限公司—A股	-	6,700	-	-	6,700
湯臣倍健股份有限公司—A股	-	17,100	-	-	17,100
中航航空電子系統股份有限公司—A股	-	7,900	-	-	7,900
中國船舶工業股份有限公司—A股	-	13,600	-	-	13,600
華夏幸福基業投資開發股份有限公司—A股	-	17,500	-	-	17,500
中國葛洲壩集團股份有限公司—A股	-	53,100	-	-	53,100
廣匯汽車服務股份有限公司—A股	-	26,200	-	-	26,200
神州高鐵技術股份有限公司—A股	-	11,300	-	-	11,300
中國核工業建設集團公司—A股	-	7,600	-	-	7,600
中國鐵建股份有限公司—A股	-	14,300	-	-	14,300
中國中鐵股份有限公司—A股	-	34,200	-	-	34,200
華潤三九醫藥股份有限公司—A股	-	2,000	-	2,000	-
中安消股份有限公司—A股	-	12,100	-	-	12,100
中國船舶重工股份有限公司—A股	-	166,700	-	-	166,700
中國船舶重工集團動力股份有限公司—A股	-	5,400	-	-	5,400
中國南方航空股份有限公司—A股	-	67,000	-	-	67,000

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
中國東方紅衛星股份有限公司—A股	-	1,600	-	-	1,600
中國建築—A股	-	6,600	-	-	6,600
中國聯合網絡—A股	-	170,000	-	7,900	162,100
中國長江電力股份有限公司—A股	-	5,300	-	-	5,300
中文天地出版傳媒股份有限公司—A股	-	10,800	-	-	10,800
重慶長安汽車股份有限公司—A股	-	5,300	-	-	5,300
中遠海運發展股份有限公司—A股 (前稱中海集裝箱運輸股份有限公司—A股)	-	60,700	-	-	60,700
中國中車股份有限公司—A股	-	79,500	-	-	79,500
中船海洋與防務裝備股份有限公司—A股	-	1,900	-	-	1,900
大秦鐵路股份有限公司—A股	-	114,900	-	-	114,900
東華軟體股份有限公司—A股	-	7,100	-	-	7,100
神州數碼信息服務股份有限公司—A股	-	3,800	-	-	3,800
東阿阿膠股份有限公司—A股	-	9,700	-	-	9,700
東方電氣股份有限公司—A股	-	12,400	-	-	12,400
鵬博士電信傳媒集團股份有限公司—A股	-	22,300	-	2,300	20,000
深圳市怡亞通供應鏈股份有限公司—A股	-	4,400	-	-	4,400
光大證券股份有限公司—A股	-	12,600	-	-	12,600
一汽轎車股份有限公司—A股	-	13,500	-	-	13,500
烽火通信科技股份有限公司—A股	-	10,300	-	-	10,300
第一創業證券股份有限公司—A股	-	3,500	-	-	3,500
福建聖農發展股份有限公司—A股	-	6,600	-	-	6,600
新城控股集團股份有限公司—A股	-	13,200	-	-	13,200
廣發證券股份有限公司—A股	-	35,000	-	-	35,000
綠地控股集團股份有限公司—A股	-	33,800	-	-	33,800
廣深鐵路股份有限公司—A股	-	64,000	-	-	64,000
廣西梧州中恒集團股份有限公司—A股	-	49,200	-	-	49,200
廣州海格通信集團股份有限公司—A股	-	4,800	-	-	4,800
國軒高科股份有限公司	-	7,200	-	-	7,200
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	-	5,300	-	-	5,300
海瀾之家股份有限公司—A股	-	6,800	-	6,800	-
河南雙匯投資發展股份有限公司—A股	-	19,500	-	-	19,500
河鋼集團有限公司—A股(前稱河北鋼鐵集團 有限公司—A股)	-	16,100	-	-	16,100
浙江核新同花順網絡信息股份有限公司—A股	-	3,400	-	-	3,400
華蘭生物工程股份有限公司—A股	-	10,300	-	-	10,300
華聞傳媒投資集團股份有限公司—A股	-	24,900	-	-	24,900
華誼兄弟傳媒股份有限公司—A股	-	31,200	-	-	31,200
華域汽車系統股份有限公司—A股	-	18,900	-	-	18,900
湖北百科藥業股份有限公司—A股	-	19,000	-	-	19,000
恒生電子股份有限公司—A股	-	9,400	-	-	9,400

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
興業銀行股份有限公司-A股	-	8,600	-	-	8,600
內蒙古君正能源化工股份有限公司-A股	-	10,200	-	-	10,200
內蒙古伊利實業集團股份有限公司-A股	-	116,000	-	3,000	113,000
江蘇省廣電有線信息網絡股份有限公司-A股	-	10,600	-	-	10,600
江蘇恒瑞醫藥股份有限公司-A股	-	28,800	-	1,600	27,200
吉林敖東藥業集團股份有限公司-A股	-	14,100	-	-	14,100
康美藥業股份有限公司-A股	-	56,700	-	-	56,700
貴州茅台酒股份有限公司-A股	-	9,400	-	-	9,400
利歐集團股份有限公司-A股	-	9,800	-	-	9,800
遼寧成大股份有限公司-A股	-	24,100	-	-	24,100
魯信創業投資集團-A股	-	4,200	-	-	4,200
瀘州老窖股份有限公司-A股	-	13,800	-	-	13,800
中國冶金科工股份有限公司-A股	-	84,500	-	-	84,500
美的集團股份有限公司-A股	-	3,800	-	-	3,800
牧原食品股份有限公司-A股	-	6,100	-	-	6,100
泛海控股股份有限公司-A股	-	5,200	-	5,200	-
東方證券股份有限公司-A股	-	6,300	-	-	6,300
太平洋證券股份有限公司-A股	-	9,300	-	-	9,300
龐大汽貿集團股份有限公司-A股	-	24,400	-	-	24,400
平安銀行股份有限公司-A股	-	23,500	-	-	23,500
上海汽車集團股份有限公司-A股	-	59,900	-	-	59,900
三一重工股份有限公司-A股	-	36,300	-	-	36,300
國投電力控股股份有限公司-A股	-	23,400	-	-	23,400
國海證券股份有限公司-A股	-	41,800	-	-	41,800
山東鋼鐵股份有限公司-A股	-	24,400	-	24,400	-
上海建工集團股份有限公司-A股	-	60,000	-	-	60,000
上海復星醫藥(集團)股份有限公司-A股	-	18,793	-	-	18,793
上海國際港務(集團)股份有限公司-A股	-	42,300	-	-	42,300
上海錦江國際酒店(集團)股份有限公司-A股	-	1,800	-	-	1,800
上海東方明珠新媒體股份有限公司-A股	-	7,800	-	-	7,800
上海隧道工程股份有限公司-A股	-	5,200	-	-	5,200
上海外高橋保稅區開發股份有限公司-A股	-	4,300	-	-	4,300
山西證券股份有限公司-A股	-	5,000	-	-	5,000
山西太鋼不銹鋼股份有限公司-A股	-	38,500	-	38,500	-
山西西山煤電股份有限公司-A股	-	25,000	-	-	25,000
深圳市匯川技術股份有限公司-A股	-	18,700	-	-	18,700
深圳歐菲光科技股份有限公司-A股	-	1,500	-	-	1,500
深圳華僑城股份有限公司-A股	-	7,000	-	-	7,000
深圳市中金嶺南有色金屬股份有限公司-A股	-	3,800	-	-	3,800
新松機器人自動化股份有限公司-A股	-	21,000	-	-	21,000
蘇寧雲商集團股份有限公司-A股	-	4,500	-	-	4,500

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
蘇寧環球股份有限公司—A股	-	18,600	-	-	18,600
陽光城集團股份有限公司—A股	-	23,900	-	-	23,900
蘇州勝利精密製造科技股份有限公司—A股	-	27,400	-	-	27,400
特變電工股份有限公司—A股	-	60,600	-	-	60,600
天齊鋰業股份有限公司—A股	-	10,200	-	-	10,200
清華同方股份有限公司—A股	-	32,900	-	-	32,900
清華紫光同方股份有限公司—A股	-	2,100	-	-	2,100
紫光國芯股份有限公司—A股	-	5,600	-	-	5,600
萬達電影院線股份有限公司—A股	-	900	-	-	900
網宿科技股份有限公司—A股	-	9,000	-	-	9,000
萬向錢潮股份有限公司—A股	-	25,000	-	5,600	19,400
華數傳媒控股股份有限公司—A股	-	2,800	-	-	2,800
滄柴動力股份有限公司—A股	-	45,600	-	-	45,600
永泰能源股份有限公司—A股	-	43,500	-	-	43,500
萬達信息股份有限公司—A股	-	2,200	-	-	2,200
宜賓五糧液股份有限公司—A股	-	35,300	-	-	35,300
徐工集團工程機械股份有限公司—A股	-	68,500	-	-	68,500
廈門建發股份有限公司—A股	-	28,500	-	-	28,500
新疆金風科技股份有限公司—A股	-	29,400	-	-	29,400
用友網絡科技股份有限公司—A股	-	2,400	-	-	2,400
遊族網絡股份有限公司—A股	-	5,000	-	-	5,000
浙江正泰電器股份有限公司—A股	-	7,900	-	-	7,900
浙江華策影視股份有限公司—A股	-	13,800	-	-	13,800
浙江萬豐奧威汽輪股份有限公司—A股	-	14,800	-	-	14,800
浙江浙能電力股份有限公司—A股	-	18,800	-	-	18,800
中聯重科股份有限公司—A股	-	85,200	-	-	85,200
中興通訊股份有限公司—A股	-	42,600	-	-	42,600

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由 CREDIT SUISSE AG, NASSAU BRANCH 發行的上市 CAAP					
中國農業銀行—A股	664,935	-	-	206,506	458,429
奧飛娛樂股份有限公司—A股 (前稱廣東奧飛動漫文化股份有限公司—A股)	11,232	1,600	-	2,246	10,586
中國鋁業股份有限公司—A股	114,255	-	-	27,750	86,505
安徽海螺水泥股份有限公司—A股	50,275	-	-	10,054	40,221
中航動力控制股份有限公司—A股	8,000	-	-	2,308	5,692
中航投資控股股份有限公司—A股	38,582	-	27,672	19,010	47,244
北京銀行股份有限公司—A股	254,682	9,600	38,461	72,376	230,367
中國銀行股份有限公司—A股	525,132	21,400	-	163,026	383,506
交通銀行股份有限公司—A股	493,048	84,600	-	150,870	426,778
南京銀行股份有限公司—A股	44,755	-	27,636	16,910	55,481
寧波銀行股份有限公司—A股	49,006	39,204	-	49,006	39,204
寶山鋼鐵股份有限公司—A股	124,153	-	-	24,830	99,323
北京金隅股份有限公司—A股	30,025	-	24,021	54,046	-
北京大北農科技集團股份有限公司—A股	7,900	-	-	7,900	-
北京神州泰岳軟件股份有限公司—A股	28,400	-	-	5,984	22,416
北汽福田汽車股份有限公司—A股	31,408	-	-	31,408	-
京東方科技集團股份有限公司—A股	287,319	-	-	118,440	168,879
比亞迪股份有限公司—A股	7,535	-	-	4,906	2,629
長江證券股份有限公司—A股	83,378	-	-	16,676	66,702
成都市興蓉環境股份有限公司—A股	43,141	-	-	43,141	-
中國寶安集團股份有限公司—A股	28,653	7,600	10,682	5,730	41,205
中信銀行股份有限公司—A股	81,662	-	-	22,732	58,930
中國中煤能源股份有限公司—A股	47,855	-	-	47,855	-
中國交通建設股份有限公司—A股	38,485	-	-	7,696	30,789
中國建設銀行股份有限公司—A股	167,332	14,500	-	54,666	127,166
中國東方航空股份有限公司—A股	19,800	10,200	-	16,908	13,092
中國光大銀行股份有限公司—A股	396,788	-	-	95,258	301,530
中國第一重型機械集團公司—A股	62,300	-	-	62,300	-
海南天然橡膠產業集團股份有限公司—A股	13,270	-	-	5,874	7,396
中國國旅股份有限公司—A股	9,776	9,320	-	9,776	9,320
中國國際海運集裝箱(集團)股份有限公司—A股	18,448	-	-	3,690	14,758
中國人壽保險股份有限公司—A股	41,475	-	-	8,294	33,181
招商銀行—A股	257,020	8,200	-	69,884	195,336
招商證券股份有限公司—A股	58,345	-	-	14,468	43,877
招商局蛇口工業區控股股份有限公司—A股	54,004	2,800	-	10,800	46,004
五礦稀土股份有限公司—A股	15,560	-	-	15,560	-
中國民生銀行—A股	594,488	18,700	-	165,518	447,670
中國北方稀土(集團)高科技股份有限公司—A股	54,775	-	-	10,954	43,821
中海油田服務股份有限公司—A股	14,839	-	-	14,839	-

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由 CREDIT SUISSE AG, NASSAU BRANCH 發行的上市 CAAP(續)					
中國太平洋保險(集團)股份有限公司-A股	78,955	1,500	-	20,930	59,525
中國石油化工股份有限公司-A股	258,416	-	-	52,812	205,604
中國中鐵股份有限公司-A股	135,396	-	-	27,080	108,316
中國神華能源股份有限公司-A股	49,733	2,800	-	14,946	37,587
中南出版傳媒集團股份有限公司-A股	17,949	-	-	17,949	-
萬科企業股份有限公司-A股	193,336	-	-	64,468	128,868
中國西電電氣股份有限公司-A股	54,000	-	-	54,000	-
中國長江電力股份有限公司-A股	-	40,000	-	40,000	-
重慶長安汽車股份有限公司-A股	52,875	-	-	21,250	31,625
中信證券股份有限公司-A股	196,093	2,600	-	49,638	149,055
中遠海運控股股份有限公司-A股(前稱中國遠洋控 股股份有限公司-A股)	72,800	13,200	-	15,354	70,646
中國中車股份有限公司-A股	148,572	-	-	56,286	92,286
大唐國際發電股份有限公司-A股	71,400	-	-	71,400	-
東華軟體股份有限公司-A股	14,516	-	-	3,964	10,552
東方電氣股份有限公司-A股	16,600	-	-	5,424	11,176
東旭光電科技股份有限公司-A股	19,060	3,000	-	8,486	13,574
東方財富信息股份有限公司-A股	28,200	2,200	20,880	12,060	39,220
光大證券股份有限公司-A股	27,400	-	-	5,836	21,564
一汽轎車股份有限公司-A股	6,474	-	-	4,054	2,420
金融街控股股份有限公司-A股	37,240	-	-	14,648	22,592
福耀玻璃工業集團股份有限公司-A股	11,290	-	-	7,138	4,152
金地(集團)股份有限公司-A股	56,416	-	-	11,284	45,132
廣發證券股份有限公司-A股	37,893	-	-	19,568	18,325
廣聯達科技股份有限公司-A股 (前稱廣聯達軟件股份有限公司-A股)	16,320	-	-	16,320	-
珠海格力電器股份有限公司-A股	119,924	-	-	28,784	91,140
廣東電力發展股份有限公司-A股	21,240	16,772	-	38,012	-
廣東錦龍發展股份有限公司-A股	10,700	-	-	2,246	8,454
廣匯能源股份有限公司-A股	78,727	-	-	15,746	62,981
廣州海格通信集團股份有限公司-A股	40,480	-	-	11,796	28,684
國信證券股份有限公司-A股	29,300	22,600	-	6,184	45,716
國元證券股份有限公司-A股	30,248	-	-	6,050	24,198
海南航空股份有限公司-A股	104,748	13,400	-	29,430	88,718
海南礦業股份有限公司-A股	4,900	-	-	4,900	-
海通證券股份有限公司-A股	201,608	-	-	48,422	153,186
杭州海康威視數字技術股份有限公司-A股	24,624	-	9,271	6,080	27,815
大族激光科技產業集團股份有限公司-A股	21,215	-	-	4,242	16,973
海瀾之家股份有限公司-A股	24,900	-	-	24,900	-

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由 CREDIT SUISSE AG, NASSAU BRANCH 發行的上市 CAAP(續)					
河鋼集團有限公司－A股 (前稱河北鋼鐵集團有限公司－A股)	116,919	-	-	43,864	73,055
華電國際電力股份有限公司－A股	25,804	-	-	25,804	-
華泰證券股份有限公司－A股	53,816	34,850	-	53,816	34,850
華聞傳媒投資集團股份有限公司－A股	19,978	4,200	-	12,976	11,202
華夏銀行股份有限公司－A股	134,205	-	-	30,440	103,765
華域汽車系統股份有限公司－A股	8,458	2,700	-	8,412	2,746
湖北能源集團股份有限公司－A股	57,845	-	-	57,845	-
湖南電廣傳媒股份有限公司－A股	28,260	-	-	5,652	22,608
科大訊飛股份有限公司－A股	20,919	1,400	-	4,184	18,135
中國工商銀行－A股	537,399	54,100	-	183,080	408,419
興業銀行股份有限公司－A股	315,903	9,900	-	86,280	239,523
興業證券股份有限公司－A股	131,586	5,600	-	47,318	89,868
內蒙古包鋼鋼聯股份有限公司－A股	224,573	15,300	-	44,914	194,959
內蒙古君正能源化工股份有限公司－A股	27,736	-	22,188	5,548	44,376
內蒙古蒙電華能熱電股份有限公司－A股	30,011	15,325	-	45,336	-
江西銅業股份有限公司－A股	22,830	-	-	7,366	15,464
金堆城鎢業股份有限公司－A股	24,287	-	-	4,858	19,429
冀中能源股份有限公司－A股	27,151	-	-	27,151	-
九州通醫藥集團股份有限公司－A股	9,320	-	-	9,320	-
康得新複合材料集團股份有限公司－A股 (前稱江蘇康得新複合材料股份有限公司－A股)	40,003	51,169	25,566	68,569	48,169
金正大生態工程集團股份有限公司－A股	15,698	5,200	12,558	3,140	30,316
樂普(北京)醫療器械股份有限公司－A股	12,231	-	8,585	20,816	-
樂視網信息技術(北京)股份有限公司－A股	22,000	1,000	-	4,646	18,354
立訊精密工業股份有限公司－A股	13,038	3,500	5,215	5,308	16,445
梅花生物科技集團股份有限公司－A股	47,059	-	-	9,412	37,647
美的集團股份有限公司－A股	47,980	23,900	18,674	10,632	79,922
國電南瑞科技股份有限公司－A股	31,422	-	-	7,272	24,150
新華人壽保險股份有限公司－A股	15,540	3,600	-	3,108	16,032
新希望六和股份有限公司－A股	10,300	12,186	12,186	10,300	24,372
東北證券股份有限公司－A股	29,455	5,891	-	7,070	28,276
泛海控股股份有限公司－A股	32,600	-	-	32,600	-
海洋石油工程股份有限公司－A股	55,537	-	-	11,108	44,429
東方證券股份有限公司－A股	25,200	30,700	-	5,308	50,592
太平洋證券股份有限公司－A股	58,900	17,670	26,848	22,874	80,544
龐大汽貿集團股份有限公司－A股	68,972	24,600	-	39,100	54,472
攀鋼集團釩鈦資源股份有限公司－A股	118,190	-	-	118,190	-
人民網股份有限公司－A股	14,690	-	-	2,938	11,752
中國石油天然氣股份有限公司－A股	122,035	-	-	24,406	97,629

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由 CREDIT SUISSE AG, NASSAU BRANCH					
發行的上市CAAP(續)					
平安銀行股份有限公司—A股	143,825	-	22,232	32,664	133,993
中國平安保險(集團)股份有限公司—A股	269,274	6,300	-	74,414	201,160
保利房地產(集團)股份有限公司—A股	161,794	14,700	-	41,758	134,736
中國電力建設集團有限公司—A股	75,101	-	-	20,556	54,545
青島海爾股份有限公司—A股	85,100	60,400	-	85,100	60,400
青海鹽湖工業股份有限公司—A股	14,033	3,200	-	2,806	14,427
榮盛房地產發展股份有限公司—A股	31,236	-	-	6,248	24,988
三一重工股份有限公司—A股	44,941	-	-	17,226	27,715
國投電力控股股份有限公司—A股	68,508	-	-	16,902	51,606
國海證券股份有限公司—A股	11,900	-	2,448	7,002	7,346
海虹企業(控股)股份有限公司—A股	18,089	-	-	3,618	14,471
陝西煤業股份有限公司—A股	50,249	-	-	10,050	40,199
山東黃金礦業股份有限公司—A股	19,569	-	-	5,514	14,055
上海電氣集團總公司—A股	25,400	-	-	14,846	10,554
上海國際港務(集團)股份有限公司—A股	37,790	-	-	16,158	21,632
上海陸家嘴金融貿易區開發股份有限公司—A股	8,612	1,900	5,512	1,722	14,302
上海東方明珠新媒體股份有限公司—A股	37,590	-	-	20,458	17,132
上海浦東發展銀行—A股	232,374	6,600	14,890	90,174	163,690
上海萊士血液製品股份有限公司—A股	14,170	-	9,068	2,834	20,404
上海城投控股股份有限公司—A股	37,213	-	-	7,442	29,771
上海外高橋保稅區開發股份有限公司—A股	5,850	-	-	1,890	3,960
山西潞安環保能源開發股份有限公司—A股	30,092	-	-	30,092	-
山西證券股份有限公司—A股	20,229	-	-	5,726	14,503
山西西山煤電股份有限公司—A股	41,195	-	-	41,195	-
申萬宏源集團股份有限公司—A股	111,965	-	31,350	22,392	120,923
深圳能源集團股份有限公司—A股	30,001	-	-	6,000	24,001
深圳歐菲光科技股份有限公司—A股	15,498	1,300	-	4,600	12,198
深圳華僑城股份有限公司—A股	91,650	-	-	37,330	54,320
深圳市中金嶺南有色金屬股份有限公司—A股	34,234	-	-	6,846	27,388
四川長虹電器股份有限公司—A股	92,015	-	-	18,402	73,613
國金證券股份有限公司—A股	45,242	-	-	9,048	36,194
中國石化上海石油化工股份有限公司—A股	42,769	7,000	-	8,554	41,215
東吳證券股份有限公司—A股	33,277	3,200	-	10,768	25,709
西南證券股份有限公司—A股	72,590	5,900	-	23,518	54,972
春秋航空股份有限公司—A股	5,600	-	-	1,200	4,400
蘇寧雲商集團股份有限公司—A股	110,341	6,400	-	50,568	66,173
蘇州金螳螂建築裝飾股份有限公司—A股	22,291	4,200	8,916	4,458	30,949
TCL集團股份有限公司—A股	212,878	-	-	84,576	128,302
天津港股份有限公司—A股	20,000	-	-	20,000	-
天津中環半導體股份有限公司—A股	18,623	-	-	6,864	11,759

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由 CREDIT SUISSE AG, NASSAU BRANCH 發行的上市 CAAP(續)					
通化東寶藥業股份有限公司—A股	21,120	-	3,043	5,904	18,259
銅陵有色金屬集團控股有限公司—A股	95,295	56,200	-	19,058	132,437
啟迪桑德環境資源股份有限公司—A股	12,137	-	-	2,428	9,709
環旭電子股份有限公司—A股	546	-	-	546	-
萬華化學集團股份有限公司—A股	28,941	-	-	8,188	20,753
濰柴動力股份有限公司—A股	876	-	-	876	-
無錫威孚高科技集團股份有限公司—A股	12,516	-	-	12,516	-
西部證券股份有限公司—A股	28,660	4,400	-	5,732	27,328
永泰能源股份有限公司—A股	59,602	-	-	17,000	42,602
武漢鋼鐵股份有限公司—A股	96,300	-	-	20,292	76,008
徐工集團工程機械股份有限公司—A股	31,200	-	-	21,182	10,018
廈門鑄業股份有限公司—A股	6,374	-	-	6,374	-
新湖中寶股份有限公司—A股	65,970	34,600	-	33,194	67,376
新興鑄管股份有限公司—A股	54,436	-	-	10,888	43,548
許繼電氣股份有限公司—A股	14,209	-	-	14,209	-
兗州煤業股份有限公司—A股	10,509	-	-	2,102	8,407
營口港務股份有限公司—A股	46,300	-	-	46,300	-
永輝超市股份有限公司—A股	51,406	41,124	41,124	51,406	82,248
雅戈爾集團股份有限公司—A股	39,491	2,800	-	12,398	29,893
浙報傳媒集團股份有限公司—A股	8,944	-	-	8,944	-
浙江中國小商品城集團股份有限公司—A股	67,777	-	-	13,556	54,221
浙江大華技術股份有限公司—A股	15,693	2,700	18,457	8,263	28,587
浙江龍盛集團股份有限公司—A股	57,185	-	-	11,436	45,749
浙江亞廈裝飾股份有限公司—A股	4,700	-	-	4,700	-
浙江浙能電力股份有限公司—A股	29,744	20,000	-	13,668	36,076
鄭州宇通客車股份有限公司—A股	33,072	26,458	-	33,072	26,458
中金黃金股份有限公司—A股	32,626	7,798	-	6,526	33,898
紫金礦業集團股份有限公司—A股	238,195	-	-	47,638	190,557

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由 CREDIT SUISSE AG, NASSAU BRANCH					
發行的非上市供股權					
東北證券股份有限公司—A股—供股權	-	-	5,891	5,891	-
太平洋證券股份有限公司—A股—供股權	-	-	17,670	17,670	-
中金黃金股份有限公司—A股—供股權	-	-	4,698	4,698	-

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由HSBC BANK PLC發行的上市CAAP</b>					
安信信託股份有限公司-A股	-	17,000	-	-	17,000
北極光光電有限公司-A股	-	4,400	-	-	4,400
北京首都開發股份有限公司-A股	-	21,500	-	-	21,500
北京歌華有線電視網絡股份有限公司-A股	-	13,400	-	-	13,400
渤海金控投資股份有限公司-A股 (前稱渤海租賃股份有限公司-A股)	44,200	-	-	8,840	35,360
中節能風力發電股份有限公司-A股	4,800	-	-	4,800	-
招商局能源運輸股份有限公司-A股	52,800	-	-	10,560	42,240
中國化學工程股份有限公司-A股	49,923	-	-	49,923	-
中國核能電力股份有限公司-A股	116,400	-	-	23,280	93,120
中國鐵建股份有限公司-A股	85,956	-	-	17,192	68,764
中國建築-A股	373,740	-	-	96,348	277,392
中國長江電力股份有限公司-A股	120,000	-	-	328	119,672
中信國安信息產業股份有限公司-A股	-	21,100	31,650	-	52,750
中信重工機械股份有限公司-A股	30,700	-	-	6,140	24,560
中糧屯河股份有限公司-A股	-	19,700	-	-	19,700
中船海洋與防務裝備股份有限公司-A股	-	4,700	-	-	4,700
東興證券股份有限公司-A股	12,500	11,700	-	2,500	21,700
深圳市怡亞通供應鏈股份有限公司-A股	-	24,200	-	-	24,200
分眾傳媒信息技術股份有限公司-A股	-	5,900	5,900	-	11,800
福耀玻璃工業集團股份有限公司-A股	24,400	-	-	-	24,400
國電電力發展股份有限公司-A股	244,800	30,500	-	48,960	226,340
綠地控股集團股份有限公司-A股	-	6,700	-	-	6,700
廣州廣電運通金融電子股份有限公司-A股	-	15,500	-	-	15,500
廣州汽車集團股份有限公司-A股	13,700	-	-	13,700	-
廣州發展集團股份有限公司-A股	-	15,700	-	15,700	-
貴州百靈企業集團製藥股份有限公司-A股	-	8,100	-	-	8,100
國泰君安證券股份有限公司-A股	38,000	53,500	-	7,600	83,900
華能國際電力股份有限公司-A股	104,679	-	-	104,679	-
浪潮電子信息產業股份有限公司-A股	-	11,500	-	-	11,500
江蘇省廣電有線信息網絡股份有限公司-A股	14,900	-	3,576	2,980	15,496
江蘇保千里視像科技集團股份有限公司-A股	-	17,700	-	-	17,700
際華集團股份有限公司-A股	38,400	-	-	7,680	30,720
上海吉祥航空股份有限公司-A股	3,400	-	-	680	2,720
北京掌趣科技股份有限公司-A股	36,900	7,800	-	7,380	37,320
國投安信股份有限公司-A股	-	21,300	-	-	21,300
山東高速股份有限公司-A股	16,700	-	-	16,700	-
上海二三四五網絡控股集團股份有限公司-A股	6,500	5,700	5,200	1,300	16,100
上海百潤投資控股集團股份有限公司-A股	-	2,900	-	-	2,900
上海電力股份有限公司-A股	21,300	-	-	4,260	17,040
上海國際機場股份有限公司-A股	24,024	-	-	4,804	19,220

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由HSBC BANK PLC發行的上市CAAP(續)</b>					
上海隧道工程股份有限公司-A股	39,200	-	-	7,840	31,360
上海張江高科技園區開發股份有限公司-A股	19,300	-	-	3,860	15,440
申能股份有限公司-A股	56,718	-	-	56,718	-
深圳市銀之傑科技股份有限公司-A股	-	5,200	-	-	5,200
深圳市金證科技股份有限公司-A股	-	9,600	-	-	9,600
四川川投能源股份有限公司-A股	54,892	-	-	10,978	43,914
中石化石油工程技術服務有限公司-A股	-	35,100	-	-	35,100
宋城演藝發展股份有限公司-A股	14,300	-	-	2,860	11,440
天地科技股份有限公司-A股	-	31,800	-	-	31,800
萬達電影院線股份有限公司-A股	3,100	6,500	-	1,620	7,980
萬達信息股份有限公司-A股	-	13,000	-	2,200	10,800
物產中大集團股份有限公司-A股	-	17,000	5,100	-	22,100
中天城投集團股份有限公司-A股	42,900	19,700	-	8,580	54,020

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由UBS AG LONDON BRANCH發行的上市CAAP</b>					
中國農業銀行—A股	287,600	-	-	44,300	243,300
愛爾眼科醫院集團股份有限公司—A股	10,845	-	-	10,845	-
中國國際航空股份有限公司—A股	56,134	5,400	-	61,534	-
航天信息股份有限公司—A股	15,062	-	10,850	25,912	-
中國鋁業股份有限公司—A股	24,500	-	-	24,500	-
鞍鋼股份有限公司—A股	51,231	-	-	51,231	-
中航動力控制股份有限公司—A股	3,538	-	-	-	3,538
中航飛機股份有限公司—A股	27,600	-	-	27,600	-
中航動力股份有限公司—A股	19,406	-	-	3,882	15,524
中航投資控股股份有限公司—A股	15,970	-	15,970	31,940	-
中航直升機有限責任公司—A股	6,155	-	-	6,155	-
交通銀行股份有限公司—A股	93,800	-	-	93,800	-
南京銀行股份有限公司—A股	6,300	-	5,040	11,340	-
北京首創股份有限公司—A股	24,400	10,000	19,520	53,920	-
北京大北農科技集團股份有限公司—A股	32,971	5,300	16,348	54,619	-
北京光線傳媒股份有限公司—A股	11,100	-	11,100	22,200	-
北京京能電力股份有限公司—A股	38,462	-	-	38,462	-
北京碧水源科技股份有限公司—A股	15,562	-	18,229	33,791	-
北京中長石基信息技術股份有限公司—A股	3,076	-	3,320	6,396	-
北京雙鷺藥業股份有限公司—A股	10,238	-	-	10,238	-
北京同仁堂股份有限公司—A股	17,064	15,052	-	21,564	10,552
北京神州泰岳軟件股份有限公司—A股	1,524	-	-	-	1,524
北京信威科技集團股份有限公司—A股 (前稱北京信威通信技術股份有限公司—A股)	29,145	2,400	-	31,545	-
北京燕京啤酒股份有限公司—A股	35,127	-	-	35,127	-
北京藍色光標品牌管理顧問股份有限公司—A股	39,026	-	-	39,026	-
京東方科技集團股份有限公司—A股	304,877	-	-	23,800	281,077
比亞迪股份有限公司—A股	7,992	-	-	7,992	-
湯臣倍健股份有限公司—A股	7,307	-	7,307	14,614	-
中航航空電子系統股份有限公司—A股	13,300	-	-	13,300	-
中國船舶工業股份有限公司—A股	17,172	-	-	17,172	-
中國東方航空股份有限公司—A股	64,736	64,736	-	86,836	42,636
中國第一重型機械集團公司—A股	3,393	3,393	-	6,786	-
華夏幸福基業投資開發股份有限公司—A股	26,409	1,700	-	28,109	-
中國葛洲壩集團股份有限公司—A股	68,822	-	-	68,822	-
海南天然橡膠產業集團股份有限公司—A股	16,100	16,100	-	16,100	16,100
招商證券股份有限公司—A股	14,000	-	-	14,000	-
中國民生銀行—A股	141,600	5,100	-	146,700	-
洛陽樂川鋁業集團股份有限公司—A股	66,454	95,964	-	87,854	74,564
中國石油化工股份有限公司—A股	5,641	-	-	5,641	-

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由UBS AG LONDON BRANCH發行的上市CAAP</b>					
<b>(續)</b>					
華潤三九醫藥股份有限公司—A股	7,988	-	-	7,988	-
中國船舶重工—A股	228,765	-	-	228,765	-
中國南方航空股份有限公司—A股	80,416	-	-	80,416	-
中國東方紅衛星股份有限公司—A股	13,295	-	-	2,658	10,637
中國聯合網絡—A股	211,219	-	-	211,219	-
中國長江電力股份有限公司—A股	138	-	-	138	-
中文天地出版傳媒股份有限公司—A股	13,155	-	-	13,155	-
重慶長安汽車股份有限公司—A股	3,377	-	-	3,377	-
重慶水務集團股份有限公司—A股	6,690	-	-	6,690	-
中遠海運發展股份有限公司—A股 (前稱中海集裝箱運輸股份有限公司—A股)	89,506	-	-	89,506	-
中遠海運控股股份有限公司—A股 (前稱中國遠洋控股股份有限公司—A股)	3,969	-	-	-	3,969
中國中車股份有限公司—A股	79,863	-	-	79,863	-
大秦鐵路股份有限公司—A股	148,169	-	-	148,169	-
大唐國際發電股份有限公司—A股	3,907	3,907	-	7,814	-
東華軟體股份—A股	5,300	-	-	5,300	-
東阿阿膠股份有限公司—A股	13,054	-	-	13,054	-
東方電氣股份有限公司—A股	10,519	-	-	10,519	-
東旭光電科技股份有限公司—A股	23,371	-	-	-	23,371
鵬博士電信傳媒集團股份有限公司—A股	27,919	-	-	27,919	-
東方財富信息股份有限公司—A股	1,569	-	1,255	-	2,824
光大證券股份有限公司—A股	1,785	-	-	-	1,785
一汽轎車股份有限公司—A股	13,800	-	-	13,800	-
佛山市海天調味食品股份有限公司—A股	7,476	-	-	7,476	-
方正證券股份有限公司—A股	100,606	-	-	20,122	80,484
廣發證券股份有限公司—A股	36,452	-	-	36,452	-
歌爾聲學股份有限公司—A股	23,117	-	-	4,624	18,493
長城汽車股份有限公司—A股	30,061	-	-	6,012	24,049
廣東電力發展股份有限公司—A股	1,097	-	-	1,097	-
廣東錦龍發展股份有限公司—A股	531	-	-	-	531
廣深鐵路股份有限公司—A股	85,847	-	-	85,847	-
廣西梧州中恒集團股份有限公司—A股	69,268	-	-	69,268	-
廣州白雲山醫藥集團股份有限公司—A股	11,137	10,609	-	11,137	10,609
國信證券股份有限公司—A股	1,624	-	-	-	1,624
海南航空股份有限公司—A股	42,400	42,400	-	42,400	42,400
海南礦業股份有限公司—A股	255	-	-	255	-
杭州海康威視數字技術股份有限公司—A股	5,780	-	2,890	8,670	-
海瀾之家股份有限公司—A股	8,945	-	-	8,945	-
河南雙匯投資發展股份有限公司—A股	24,855	-	-	24,855	-

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由UBS AG LONDON BRANCH發行的上市CAAP (續)					
青島海信電器股份有限公司—A股	19,817	15,853	-	19,817	15,853
華電國際電力股份有限公司—A股	28,350	-	-	28,350	-
華東醫藥股份有限公司—A股	5,612	4,490	-	5,612	4,490
華蘭生物工程股份有限公司—A股	5,992	1,100	2,876	9,968	-
華泰證券股份有限公司—A股	28,519	-	-	-	28,519
華聞傳媒投資集團股份有限公司—A股	20,900	-	-	20,900	-
華誼兄弟傳媒股份有限公司—A股	24,545	-	19,620	44,165	-
華域汽車系統股份有限公司—A股	17,600	-	-	17,600	-
恒生電子股份有限公司—A股	12,385	-	-	12,385	-
興業銀行股份有限公司—A股	16,400	-	-	16,400	-
內蒙古蒙華能熱電股份有限公司—A股	43,424	-	-	43,424	-
內蒙古伊利實業集團股份有限公司—A股	151,128	2,500	-	153,628	-
江蘇恒瑞醫藥股份有限公司—A股	29,215	-	4,674	33,889	-
江蘇鳳凰出版傳媒股份有限公司—A股	19,004	-	-	3,800	15,204
江蘇洋河酒廠股份有限公司—A股	15,020	-	-	3,004	12,016
吉林敖東藥業集團股份有限公司—A股	18,060	-	-	18,060	-
康美藥業股份有限公司—A股	84,584	-	-	84,584	-
貴州茅台酒股份有限公司—A股	12,472	100	-	12,572	-
樂視網信息技術(北京)股份有限公司—A股	1,231	-	-	-	1,231
遼寧成大股份有限公司—A股	34,286	-	-	34,286	-
魯信創業投資集團—A股	7,457	-	-	7,457	-
瀘州老窖股份有限公司—A股	17,663	1,300	-	18,963	-
中國冶金科工股份有限公司—A股	121,346	-	-	121,346	-
美的集團股份有限公司—A股	5,180	-	2,590	7,770	-
國電南瑞科技股份有限公司—A股	4,936	4,936	-	4,936	4,936
東軟集團股份有限公司—A股	16,749	24,799	-	22,449	19,099
新希望六和股份有限公司—A股	7,773	-	7,773	-	15,546
寧波舟山港股份有限公司—A股 (前稱寧波港股份有限公司—A股)	111,846	75,636	-	111,846	75,636
泛海控股股份有限公司—A股	1,785	-	-	1,785	-
東方證券股份有限公司—A股	1,338	-	-	-	1,338
太平洋證券股份有限公司—A股	29,076	8,722	18,899	22,000	34,697
龐大汽貿集團股份有限公司—A股	4,524	-	-	4,524	-
中國電力建設集團有限公司—A股	27,678	-	-	-	27,678
榮盛房地產發展股份有限公司—A股	7,106	-	-	7,106	-
上海汽車集團股份有限公司—A股	82,390	-	-	82,390	-
三安光電股份有限公司—A股	35,743	31,643	15,189	42,071	40,504
三一重工股份有限公司—A股	41,188	7,400	-	48,588	-
國投電力控股股份有限公司—A股	16,000	-	-	16,000	-
國海證券股份有限公司—A股	23,113	-	11,556	34,669	-

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
由UBS AG LONDON BRANCH發行的上市CAAP					
(續)					
上海百聯集團股份有限公司-A股	17,105	13,685	-	17,105	13,685
上海建工集團股份有限公司-A股	48,170	9,100	7,707	64,977	-
上海電氣集團總公司-A股	48,831	-	-	48,831	-
上海復星醫藥(集團)股份有限公司-A股	28,519	-	-	28,519	-
上海國際港務(集團)股份有限公司-A股	43,000	-	-	43,000	-
上海家化聯合股份有限公司-A股	13,438	-	-	13,438	-
上海東方明珠新媒體股份有限公司-A股	8,200	-	-	8,200	-
上海醫藥集團股份有限公司-A股	27,534	-	-	5,506	22,028
上海外高橋保稅區開發股份有限公司-A股	3,600	-	-	3,600	-
山西證券股份有限公司-A股	11,403	5,403	-	15,503	1,303
山西太鋼不銹鋼股份有限公司-A股	63,231	-	-	63,231	-
深圳市農產品股份有限公司-A股	17,345	3,500	-	7,968	12,877
深圳市海普瑞藥業股份有限公司-A股	7,025	4,321	2,592	13,938	-
深圳市匯川技術股份有限公司-A股	11,769	-	9,413	21,182	-
深圳信立泰藥業股份有限公司-A股	7,843	6,275	-	14,118	-
新松機器人自動化股份有限公司-A股	11,538	-	13,845	25,383	-
四川科倫藥業股份有限公司-A股	21,566	-	-	21,566	-
東吳證券股份有限公司-A股	20,564	-	-	6,000	14,564
春秋航空股份有限公司-A股	400	-	-	-	400
天士力製藥集團股份有限公司-A股	16,172	12,938	-	16,172	12,938
特變電工股份有限公司-A股	64,810	-	-	64,810	-
天津港股份有限公司-A股	1,076	-	-	1,076	-
天津中環半導體股份有限公司-A股	15,700	-	-	15,700	-
清華同方股份有限公司-A股	45,524	2,700	-	48,224	-
青島啤酒股份有限公司-A股	6,974	-	-	6,974	-
環旭電子股份有限公司-A股	7,700	-	-	7,700	-
網宿科技股份有限公司-A股	12,372	-	-	12,372	-
萬向錢潮股份有限公司-A股	28,845	-	-	28,845	-
華數傳媒控股股份有限公司-A股	3,215	13,973	-	8,915	8,273
濰柴動力股份有限公司-A股	53,882	4,700	-	58,582	-
永泰能源股份有限公司-A股	25,400	-	-	25,400	-
武漢鋼鐵股份有限公司-A股	5,162	-	-	-	5,162
宜賓五糧液股份有限公司-A股	47,269	3,200	-	50,469	-
徐工集團工程機械股份有限公司-A股	74,711	-	-	74,711	-
廈門建發股份有限公司-A股	24,011	9,800	-	33,811	-
廈門鎔業股份有限公司-A股	4,511	-	-	4,511	-
新疆金風科技股份有限公司-A股	38,751	-	-	38,751	-
煙台傑瑞石油服務集團股份有限公司-A股	10,509	-	-	10,509	-
營口港務股份有限公司-A股	2,469	-	-	2,469	-
用友網絡科技股份有限公司-A股	14,510	13,408	-	16,910	11,008

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>由UBS AG LONDON BRANCH發行的上市CAAP</b>					
<b>(續)</b>					
雲南白藥集團股份有限公司—A股	12,969	-	-	12,969	-
浙報傳媒集團股份有限公司—A股	7,551	-	-	7,551	-
浙江大華技術股份有限公司—A股	1,250	-	1,875	3,125	-
浙江華策影視股份有限公司—A股	10,731	-	5,151	15,882	-
浙江亞廈裝飾股份有限公司—A股	12,000	-	-	12,000	-
浙江浙能電力股份有限公司—A股	38,598	-	-	18,000	20,598
中聯重科股份有限公司—A股	97,013	9,500	-	106,513	-
中興通訊股份有限公司—A股	58,769	-	-	58,769	-
<b>由UBS AG LONDON BRANCH</b>					
<b>發行的非上市供股權</b>					
太平洋證券股份有限公司—A股—供股權	-	-	8,722	8,722	-

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 所持抵押品(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

抵押品提供者	抵押品提供者之 信貸評級 <sup>1</sup>	抵押品之性質	抵押品所覆蓋之 資產淨值百分比	抵押品之價值 港元
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	A	上市股本	38.65%	74,862,109
		固定收入證券	25.71%	49,798,108
HSBC Bank plc	AA-	上市股本	9.30%	18,004,722
		固定收入證券	2.66%	5,154,734
UBS AG London Branch	A+	上市股本	8.21%	15,911,394
			84.53%	163,731,067

## 固定收入抵押品之信貸評級

抵押品提供者	評級機構	信貸評級	抵押品所覆蓋之 資產淨值百分比	抵押品之價值 港元
Credit Suisse Securities (Europe) Limited	穆迪 <sup>2</sup>	Aaa	25.71%	49,798,108
HSBC Bank plc	穆迪 <sup>2</sup>	Aa1	2.66%	5,154,734
			28.37%	54,952,842

<sup>1</sup> 標準普爾評級服務公司對優先長期債務的信貸評級

<sup>2</sup> 穆迪評級服務公司對長期債務的信貸評級

# iShares安碩滬深300 A股指數ETF\* (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 港元	成分基金交易 資產淨值 港元
截至下列日期財務期間結束時		
二零一四年十二月三十一日	29.59	384,645,987
二零一五年十二月三十一日	29.25	292,498,075
二零一六年十二月三十一日	24.21	193,698,426

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 港元	最低每單位 資產淨值 港元
截至下列日期止財務期間		
二零一零年十二月三十一日(自成立以來)	33.18	23.07
二零一一年十二月三十一日	31.34	21.51
二零一二年十二月三十一日	25.01	18.66
二零一三年十二月三十一日	23.86	18.87
二零一四年十二月三十一日	29.59	17.71
二零一五年十二月三十一日	44.41	23.96
二零一六年十二月三十一日	27.54	21.97

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(98.72%)	持股量	公平價值 美元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(98.72%)</b>			
<b>南韓(98.72%)</b>			
Able C&C	254	4,353	0.03
Amorepacific Corp	714	190,057	1.41
Amorepacific Group	630	69,374	0.51
BGF Retail Co Ltd	378	25,601	0.19
Binggrae Co Ltd	126	6,656	0.05
BNK Financial Group Inc	6,531	46,936	0.35
Boryung Pharmaceutical Co	88	4,517	0.03
Bukwang Pharmaceutical Co	705	15,410	0.11
Byucksan Corporation	987	3,808	0.03
Cheil Worldwide Inc	1,533	19,991	0.15
Chokwang Leather Co Ltd	42	1,483	0.01
Chong Kun Dang Pharmaceutica	147	12,719	0.09
CJ Cheiljedang Corp	179	52,983	0.39
CJ Corp	294	45,519	0.34
CJ Korea Express Corp	210	31,123	0.23
Cosmax Inc	163	16,127	0.12
Coway Co Ltd	1,113	81,369	0.60
Crown Confectionery Co Ltd	147	3,420	0.03
Cuckoo Electronics Co Ltd	63	6,729	0.05
Daeduck Electronics Co	756	5,108	0.04
Daekyo Co Ltd	567	3,817	0.03
Daelim Industrial Co Ltd	630	45,432	0.34
Daesang Corporation	462	10,098	0.07
Daewoo Engineering & Constr	4,620	19,432	0.14
Daewoo Shipbuilding & Marine	2,900	9,681	0.07
Daewoong Pharmaceutical Co	126	7,167	0.05
Dong Ah Tire & Rubber Co Ltd	210	4,329	0.03
Dong-A Socio Holdings Co Ltd	84	10,884	0.08
Dong-A St Co Ltd	147	12,840	0.10
Dongbu Hitek Co Ltd	798	10,505	0.08
Dongbu Insurance Co Ltd	1,092	56,508	0.42
Dongkuk Steel Mill Co Ltd	1,596	14,602	0.11
Dongwon F&B Co Ltd	21	3,443	0.03
Dongwon Systems Corp	84	4,152	0.03
Doosan Corp	168	14,605	0.11
Doosan Heavy Industries	1,302	29,321	0.22
Doosan Infracore Co Ltd	2,772	20,243	0.15
E-Mart Inc	462	70,000	0.52
Farmsco	336	3,283	0.02
Foosung Co Ltd	1,029	6,253	0.05
Grand Korea Leisure Co Ltd	693	11,734	0.09

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(98.72%)(續)	持股量	公平價值 美元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(98.72%)(續)</b>			
<b>南韓(98.72%)(續)</b>			
Green Cross Corp	126	16,379	0.12
GS Holdings	1,134	50,794	0.38
GS Retail Co Ltd	609	24,001	0.18
Halla Holdings Corp	168	8,429	0.06
Hana Financial Group	6,258	161,916	1.20
Hanall Biopharma Co Ltd	756	8,231	0.06
Handsome Co Ltd	294	8,483	0.06
Hanil Cement Co Ltd	84	5,286	0.04
Hanjin Heavy Indus & Const	1,470	4,095	0.03
Hankook Shell Oil Co Ltd	5	1,834	0.01
Hankook Tire Co Ltd	1,659	79,667	0.59
Hankook Tire Worldwide Co Lt	525	9,019	0.07
Hanmi Pharm Co Ltd	147	37,182	0.28
Hanmi Science Co Ltd	399	20,185	0.15
Hanon Systems	5,943	50,681	0.38
Hansae Co Ltd	357	7,582	0.06
Hansol Chemical Co Ltd	189	13,035	0.10
Hansol Technics Co Ltd	378	4,835	0.04
Hanssem Co Ltd	210	34,600	0.26
Hanwha Chemical Corp	2,394	48,958	0.36
Hanwha Corporation	1,008	29,252	0.22
Hanwha Life Insurance Co Ltd	7,728	41,782	0.31
Hanwha Techwin Co Ltd	819	29,463	0.22
Hite Jinro Co Ltd	693	12,107	0.09
Hitejinro Holdings Co Ltd	147	1,515	0.01
Hotel Shilla Co Ltd	735	29,301	0.22
Huchems Fine Chemical Corp	546	9,810	0.07
Hyosung Corporation	504	60,715	0.45
Hyundai Dept Store Co	336	30,323	0.22
Hyundai Development Co-Engin	1,411	52,512	0.39
Hyundai Elevator Co	378	17,964	0.13
Hyundai Engineering & Const	1,617	57,301	0.42
Hyundai Glovis Co Ltd	420	53,726	0.40
Hyundai Greenfood Co Ltd	1,197	15,262	0.11
Hyundai Heavy Industries	1,092	131,550	0.98
Hyundai Home Shopping Networ	168	15,509	0.11
Hyundai Livart Co Ltd	273	5,357	0.04
Hyundai Marine & Fire Ins Co	1,392	36,304	0.27
Hyundai Mipo Dockyard	273	15,189	0.11
Hyundai Mobis Co Ltd	1,512	330,492	2.45
Hyundai Motor Co	3,423	413,775	3.07

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(98.72%)(續)	持股量	公平價值 美元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(98.72%)(續)</b>			
<b>南韓(98.72%)(續)</b>			
Hyundai Rotem Company	1,050	15,779	0.12
Hyundai Steel Co	1,932	91,177	0.68
Hyundai Wia Corp	336	20,308	0.15
IL Dong Holdings Co Ltd	102	2,179	0.02
Iljin Materials Co Ltd	357	4,123	0.03
Ilshin Spinning Co Ltd	21	2,147	0.02
Ilyang Pharmaceutical Co Ltd	273	9,414	0.07
Industrial Bank of Korea	6,237	65,582	0.49
IS Dongseo Co Ltd	210	7,746	0.06
Jeil Pharmaceutical Co	126	8,419	0.06
JW Pharmaceutical	257	11,214	0.08
Kangwon Land Inc	3,087	91,373	0.68
KB Financial Group Inc	8,773	310,883	2.31
KCC Corp	109	32,444	0.24
Kepeco Engineering & Construc	294	5,757	0.04
Kepeco Plant Service & Engine	504	22,617	0.17
KIA Motors Corp	5,859	190,400	1.41
KISCO Corp	84	2,577	0.02
Kiswire Ltd	126	4,189	0.03
Kolon Industries Inc	357	21,873	0.16
Korea Aerospace Industries	1,512	83,875	0.62
Korea Electric Power Corp	7,140	260,405	1.93
Korea Electric Terminal Co	168	10,947	0.08
Korea Gas Corporation	819	32,854	0.24
Korea Investment Holdings Co	924	32,055	0.24
Korea Kolmar Co Ltd	378	20,593	0.15
Korea Petro Chemical Ind	63	14,370	0.11
Korea Zinc Co Ltd	189	74,329	0.55
Korean Air Lines Co Ltd	1,050	23,777	0.18
KT Corp	4,991	121,490	0.90
KT&G Corp	2,444	204,375	1.52
Kukdo Chemical Co Ltd	105	4,773	0.04
Kumho Petrochemical Co Ltd	399	27,089	0.20
Kumho Tire Co Inc	3,171	22,264	0.16
Kwang Dong Pharmaceutical Co	756	5,333	0.04
Kyungbang Ltd	210	2,660	0.02
LF Corp	420	7,494	0.06
LG Chem Ltd	1,029	222,362	1.65
LG Corp	2,121	105,365	0.78
LG Display Co Ltd	5,187	135,065	1.00
LG Electronics Inc	2,284	97,578	0.72

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(98.72%)(續)	持股量	公平價值 美元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(98.72%)(續)</b>			
<b>南韓(98.72%)(續)</b>			
LG Hausys Ltd	147	11,648	0.09
LG Household & Health Care	210	149,006	1.10
LG Innotek Co Ltd	315	23,055	0.17
LG International Corp	609	14,748	0.11
LG Life Sciences Ltd	252	14,083	0.10
LG Uplus Corp	6,321	59,923	0.44
Lock&Lock Co Ltd	357	4,286	0.03
Lotte Chemical Corp	332	101,431	0.75
Lotte Chilsung Beverage Co	12	14,506	0.11
Lotte Confectionery Co Ltd	126	18,621	0.14
Lotte Fine Chemical Co Ltd	378	9,592	0.07
Lotte Food Co Ltd	11	5,911	0.04
Lotte Shopping Co	210	38,512	0.29
LS Corp	399	19,590	0.15
LS Industrial Systems	357	11,749	0.09
Mando Corp	167	32,424	0.24
Meritz Securities Co Ltd	6,500	18,621	0.14
Mirae Asset Daewoo Co Ltd	4,011	24,043	0.18
Mirae Asset Securities Co Lt	1,659	28,158	0.21
Muhak Co Ltd	315	5,959	0.04
Namhae Chemical Corp	504	3,505	0.03
Namyang Dairy Products Co	10	6,077	0.04
Naver Corp	587	376,656	2.79
Ncsoft Corp	399	81,762	0.61
Nexen Tire Corp	861	9,267	0.07
NH Investment & Securities C	3,444	27,517	0.20
Nongshim Co Ltd	63	17,344	0.13
OCI Co Ltd	336	21,894	0.16
Orion Corp	77	41,758	0.31
Ottogi Corporation	32	17,539	0.13
Poongsan Corp	441	14,788	0.11
POSCO	1,652	352,202	2.61
POSCO DAEWOO Corp	882	19,717	0.15
S&T Dynamics Co Ltd	441	3,396	0.03
S&T Motiv Co Ltd	210	8,494	0.06
S-1 Corporation	546	39,646	0.29
Samkwang Glass	63	3,495	0.03
Samsung C&T Corp	1,911	198,568	1.47
Samsung Card Co	777	25,540	0.19
Samsung Electro-Mechanics Co	1,323	55,645	0.41
Samsung Electronics Co Ltd	2,344	3,497,175	25.94
Samsung Engineering Co Ltd	2,835	24,177	0.18

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(98.72%)(續)	持股量	公平價值 美元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(98.72%)(續)</b>			
<b>南韓(98.72%)(續)</b>			
Samsung Fire & Marine Ins	798	177,399	1.32
Samsung Heavy Industries	5,411	41,440	0.31
Samsung Life Insurance Co Ltd	2,226	207,340	1.54
Samsung Sdi Co Ltd	1,155	104,235	0.77
Samsung Sds Co Ltd	693	80,041	0.59
Samsung Securities Co Ltd	1,281	33,621	0.25
Samyang Corp	63	5,477	0.04
Samyang Holdings Corp	105	10,389	0.08
Seah Besteel Corp	273	5,775	0.04
Seah Steel Corporation	63	4,830	0.04
Sebang Global Battery Co Ltd	189	5,852	0.04
Shinhan Financial Group Ltd	9,499	355,878	2.64
Shinsegae Inc	168	24,481	0.18
Sindoh Co Ltd	126	5,727	0.04
SK Chemicals Co Ltd	378	20,969	0.16
SK Holdings Co Ltd	777	147,642	1.09
SK Hynix Inc	12,957	479,531	3.56
SK Innovation Co Ltd	1,554	188,492	1.40
SK Networks Co Ltd	3,318	19,010	0.14
SK Telecom	1,260	233,681	1.73
SKC Co Ltd	462	12,623	0.09
SL Corp	273	4,871	0.04
S-Oil Corp	1,008	70,689	0.52
SPC Samlip	42	5,894	0.04
Ssangyong Cement Ind	1,596	19,557	0.14
Ssangyong Motor Co	924	6,036	0.04
Suheung Co Ltd	126	3,876	0.03
Taekwang Industrial Co Ltd	3	2,352	0.02
Tongyang Inc	4,788	11,833	0.09
Unid Co Ltd	105	3,886	0.03
Woori Bank	6,783	71,604	0.53
Young Poong Corporation	10	8,809	0.07
永元公司	483	12,257	0.09
Yuhan Corp	195	32,209	0.24
Yungjin Pharmaceutical Co	1,974	14,415	0.11
投資總額		13,310,016	98.72
其他資產淨值		172,401	1.28
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日應佔的資產淨值		13,482,417	100.00
投資總額(按成本)		13,404,256	

# iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF

( iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金 )

## 投資組合變動報表( 未經審核 )

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
Able C&C	-	341	23	110	254
Amorepacific Corp	-	1,054	-	340	714
Amorepacific Group	-	930	-	300	630
BGF Retail Co Ltd	-	279	225	126	378
Binggrae Co Ltd	-	186	-	60	126
BNK Financial Group Inc	-	9,641	-	3,110	6,531
Boryung Pharmaceutical Co	-	124	4	40	88
Bukwang Pharmaceutical Co	-	868	117	280	705
Byucksan Corporation	-	1,457	-	470	987
Cheil Worldwide Inc	-	2,263	-	730	1,533
Chokwang Leather Co Ltd	-	62	-	20	42
Chong Kun Dang Pharmaceutica	-	217	-	70	147
CJ Cheiljedang Corp	-	269	-	90	179
CJ Corp	-	434	-	140	294
CJ Korea Express Corp	-	310	-	100	210
Cosmax Inc	-	233	-	70	163
Coway Co Ltd	-	1,643	-	530	1,113
Crown Confectionery Co Ltd	-	217	-	70	147
Cuckoo Electronics Co Ltd	-	93	-	30	63
Daeduck Electronics Co	-	1,116	-	360	756
Daekyo Co Ltd	-	837	-	270	567
Daelim Industrial Co Ltd	-	930	-	300	630
Daesang Corporation	-	682	-	220	462
Daewoo Engineering & Constr	-	6,820	-	2,200	4,620
Daewoo Shipbuilding & Marine	-	2,900	-	-	2,900
Daewoong Pharmaceutical Co	-	186	-	60	126
Dong Ah Tire & Rubber Co Ltd	-	310	-	100	210
Dong-A Socio Holdings Co Ltd	-	124	-	40	84
Dong-A St Co Ltd	-	217	-	70	147
Dongbu Hitek Co Ltd	-	1,178	-	380	798
Dongbu Insurance Co Ltd	-	1,612	-	520	1,092
Dongkuk Steel Mill Co Ltd	-	2,356	-	760	1,596
Dongwon F&B Co Ltd	-	31	-	10	21
Dongwon Systems Corp	-	124	-	40	84
Doosan Corp	-	248	-	80	168
Doosan Heavy Industries	-	1,922	-	620	1,302
Doosan Infracore Co Ltd	-	4,092	-	1,320	2,772
E-Mart Inc	-	682	-	220	462
Farmsco	-	496	-	160	336
Foosung Co Ltd	-	1,519	-	490	1,029
Grand Korea Leisure Co Ltd	-	1,023	-	330	693

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Green Cross Corp	-	186	-	60	126
GS Holdings	-	1,674	-	540	1,134
GS Retail Co Ltd	-	899	-	290	609
Halla Holdings Corp	-	248	-	80	168
Hana Financial Group	-	9,238	-	2,980	6,258
Hanall Biopharma Co Ltd	-	1,116	-	360	756
Handsome Co Ltd	-	434	-	140	294
Hanil Cement Co Ltd	-	124	-	40	84
Hanjin Heavy Indus & Const	-	2,170	-	700	1,470
Hankook Shell Oil Co Ltd	-	31	-	26	5
Hankook Tire Co Ltd	-	2,449	-	790	1,659
Hankook Tire Worldwide Co Lt	-	775	-	250	525
Hanmi Pharm Co Ltd	-	217	-	70	147
Hanmi Science Co Ltd	-	589	-	190	399
Hanon Systems	-	8,773	-	2,830	5,943
Hansae Co Ltd	-	527	-	170	357
Hansol Chemical Co Ltd	-	279	-	90	189
Hansol Technics Co Ltd	-	558	-	180	378
Hanssem Co Ltd	-	310	-	100	210
Hanwha Chemical Corp	-	3,534	-	1,140	2,394
Hanwha Corporation	-	1,488	-	480	1,008
Hanwha Life Insurance Co Ltd	-	11,408	-	3,680	7,728
Hanwha Techwin Co Ltd	-	1,209	-	390	819
Hite Jinro Co Ltd	-	1,023	-	330	693
Hitejinro Holdings Co Ltd	-	217	-	70	147
Hotel Shilla Co Ltd	-	1,085	-	350	735
Huchems Fine Chemical Corp	-	806	-	260	546
Hyosung Corporation	-	744	-	240	504
Hyundai Dept Store Co	-	496	-	160	336
Hyundai Development Co-Engin	-	2,075	-	664	1,411
Hyundai Elevator Co	-	558	-	180	378
Hyundai Engineering & Const	-	2,387	-	770	1,617
Hyundai Glovis Co Ltd	-	620	-	200	420
Hyundai Greenfood Co Ltd	-	1,767	-	570	1,197
Hyundai Heavy Industries	-	1,612	-	520	1,092
Hyundai Home Shopping Networ	-	248	-	80	168
Hyundai Livart Co Ltd	-	403	-	130	273
Hyundai Marine & Fire Ins Co	-	1,656	-	264	1,392
Hyundai Mipo Dockyard	-	403	-	130	273
Hyundai Mobis Co Ltd	-	2,232	-	720	1,512
Hyundai Motor Co	-	5,053	-	1,630	3,423

# iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Hyundai Rotem Company	-	1,550	-	500	1,050
Hyundai Securities Co	-	4,681	-	4,681	-
Hyundai Steel Co	-	2,852	-	920	1,932
Hyundai Wia Corp	-	496	-	160	336
IL Dong Holdings Co Ltd	-	547	-	445	102
IL Dong Pharmaceutical Co Ltd	-	302	-	302	-
Iljin Materials Co Ltd	-	527	-	170	357
Ilshin Spinning Co Ltd	-	31	-	10	21
Ilyang Pharmaceutical Co Ltd	-	403	-	130	273
Industrial Bank of Korea	-	9,207	-	2,970	6,237
IS Dongseo Co Ltd	-	310	-	100	210
Jeil Pharmaceutical Co	-	186	-	60	126
JW Pharmaceutical	-	372	5	120	257
Kangwon Land Inc	-	4,557	-	1,470	3,087
KB Financial Group Inc	-	12,779	-	4,006	8,773
KCC Corp	-	186	-	77	109
Kepeco Engineering & Construc	-	434	-	140	294
Kepeco Plant Service & Engine	-	744	-	240	504
KIA Motors Corp	-	8,649	-	2,790	5,859
KISCO Corp	-	124	-	40	84
Kiswire Ltd	-	186	-	60	126
Kolon Industries Inc	-	527	-	170	357
Korea Aerospace Industries	-	2,232	-	720	1,512
Korea Electric Power Corp	-	10,540	-	3,400	7,140
Korea Electric Terminal Co	-	248	-	80	168
Korea Gas Corporation	-	1,209	-	390	819
Korea Investment Holdings Co	-	1,364	-	440	924
Korea Kolmar Co Ltd	-	558	-	180	378
Korea Petro Chemical Ind	-	93	-	30	63
Korea Zinc Co Ltd	-	279	-	90	189
Korean Air Lines Co Ltd	-	1,550	-	500	1,050
KT Corp	-	6,279	-	1,288	4,991
KT&G Corp	-	3,592	-	1,148	2,444
Kukdo Chemical Co Ltd	-	155	-	50	105
Kumho Petrochemical Co Ltd	-	589	-	190	399
Kumho Tire Co Inc	-	4,681	-	1,510	3,171
Kwang Dong Pharmaceutical Co	-	1,116	-	360	756
Kyungbang Ltd	-	31	225	46	210
LF Corp	-	620	-	200	420
LG Chem Ltd	-	1,519	-	490	1,029

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
LG Corp	-	3,131	-	1,010	2,121
LG Display Co Ltd	-	7,657	-	2,470	5,187
LG Electronics Inc	-	3,503	-	1,219	2,284
LG Hausys Ltd	-	217	-	70	147
LG Household & Health Care	-	310	-	100	210
LG Innotek Co Ltd	-	465	-	150	315
LG International Corp	-	899	-	290	609
LG Life Sciences Ltd	-	372	-	120	252
LG Uplus Corp	-	9,331	-	3,010	6,321
Lock&Lock Co Ltd	-	527	-	170	357
Lotte Chemical Corp	-	516	-	184	332
Lotte Chilsung Beverage Co	-	31	-	19	12
Lotte Confectionery Co Ltd	-	186	-	60	126
Lotte Fine Chemical Co Ltd	-	558	-	180	378
Lotte Food Co Ltd	-	31	-	20	11
Lotte Shopping Co	-	310	-	100	210
LS Corp	-	589	-	190	399
LS Industrial Systems	-	527	-	170	357
Mando Corp	-	241	-	74	167
Meritz Securities Co Ltd	-	6,500	-	-	6,500
Mirae Asset Daewoo Co Ltd	-	5,921	-	1,910	4,011
Mirae Asset Securities Co Lt	-	2,449	-	790	1,659
Muhak Co Ltd	-	465	-	150	315
Namhae Chemical Corp	-	744	-	240	504
Namyang Dairy Products Co	-	10	-	-	10
Naver Corp	-	861	-	274	587
Ncsoft Corp	-	589	-	190	399
Nexen Tire Corp	-	1,271	-	410	861
NH Investment & Securities C	-	5,084	-	1,640	3,444
Nongshim Co Ltd	-	124	-	61	63
OCI Co Ltd	-	496	-	160	336
Orion Corp	-	124	-	47	77
Ottogi Corporation	-	50	-	18	32
Poongsan Corp	-	651	-	210	441
POSCO	-	2,442	-	790	1,652
POSCO DAEWOO Corp	-	1,302	-	420	882
S&T Dynamics Co Ltd	-	651	-	210	441
S&T Motiv Co Ltd	-	310	-	100	210
S-1 Corporation	-	806	-	260	546
Samkwang Glass	-	93	-	30	63

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Samsung C&T Corp	-	2,821	-	910	1,911
Samsung Card Co	-	1,147	-	370	777
Samsung Electro-Mechanics Co	-	1,953	-	630	1,323
Samsung Electronics Co Ltd	-	3,528	-	1,184	2,344
Samsung Engineering Co Ltd	-	4,185	-	1,350	2,835
Samsung Fire & Marine Ins	-	1,178	-	380	798
Samsung Heavy Industries	-	7,397	-	1,986	5,411
Samsung Life Insurance Co Ltd	-	3,286	-	1,060	2,226
Samsung Sdi Co Ltd	-	1,705	-	550	1,155
Samsung Sds Co Ltd	-	1,023	-	330	693
Samsung Securities Co Ltd	-	1,891	-	610	1,281
Samyang Corp	-	93	-	30	63
Samyang Holdings Corp	-	155	-	50	105
Seah Besteel Corp	-	403	-	130	273
Seah Steel Corporation	-	93	-	30	63
Sebang Global Battery Co Ltd	-	279	-	90	189
Shinhan Financial Group Ltd	-	13,977	-	4,478	9,499
Shinsegae Inc	-	248	-	80	168
Sindoh Co Ltd	-	186	-	60	126
SK Chemicals Co Ltd	-	558	-	180	378
SK Holdings Co Ltd	-	1,147	-	370	777
SK Hynix Inc	-	19,127	-	6,170	12,957
SK Innovation Co Ltd	-	2,294	-	740	1,554
SK Networks Co Ltd	-	4,898	-	1,580	3,318
SK Telecom	-	1,860	-	600	1,260
SKC Co Ltd	-	682	-	220	462
SL Corp	-	403	-	130	273
S-Oil Corp	-	1,488	-	480	1,008
SPC Samlip	-	62	-	20	42
Ssangyong Cement Ind	-	2,356	-	760	1,596
Ssangyong Motor Co	-	1,364	-	440	924
Suheung Co Ltd	-	186	-	60	126
Taekwang Industrial Co Ltd	-	10	-	7	3
Tongyang Inc	-	7,068	-	2,280	4,788
Unid Co Ltd	-	155	-	50	105
Woori Bank	-	10,013	-	3,230	6,783
Young Poong Corporation	-	20	-	10	10
永元公司	-	713	-	230	483
Yuhan Corp	-	276	9	90	195
Yungjin Pharmaceutical Co	-	2,914	-	940	1,974

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市供股權</b>					
Cosmax Inc—供股權	-	-	16	16	-
Samsung Heavy Indu—供股權	-	-	2,468	2,468	-
<b>非上市供股權</b>					
Hanwha Corporation —供股權	-	-	384	384	-

# iShares安碩核心韓國綜合股價200指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 美元	成分基金交易 資產淨值 美元
截至下列日期財務期間結束時 二零一六年十二月三十一日	1.07	13,482,530

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 美元	最低每單位 資產淨值 美元
截至下列日期止財務期間 二零一六年十二月三十一日(自成立以來)	1.17	1.00

# iShares安碩核心MSCI 台灣指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.64%)	持股量	公平價值 美元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.64%)</b>			
<b>台灣(99.64%)</b>			
宏碁股份有限公司	118,360	48,109	0.24
日月光半導體製造股份有限公司	255,762	262,277	1.32
研華股份有限公司	13,760	108,657	0.55
亞洲水泥股份有限公司	101,040	82,609	0.42
亞太電信有限公司	85,096	27,328	0.14
華碩電腦股份有限公司	28,693	235,926	1.19
友達光電股份有限公司	358,922	131,412	0.66
鎧勝控股有限公司	5,456	14,542	0.07
可成科技股份有限公司	27,530	191,341	0.97
國泰金融控股股份有限公司	337,294	504,439	2.54
中租控股股份有限公司	43,406	74,209	0.37
彰化商業銀行股份有限公司	208,059	110,714	0.56
正新橡膠工業股份有限公司	78,174	147,475	0.74
群光電子股份有限公司	21,400	49,800	0.25
中華航空股份有限公司	106,040	30,599	0.15
中華開發金融控股股份有限公司	549,384	137,393	0.69
中國人壽保險股份有限公司	144,390	143,588	0.72
中國鋼鐵股份有限公司	483,732	369,977	1.87
中華電信股份有限公司	156,032	491,397	2.48
仁寶電腦工業股份有限公司	171,512	98,185	0.50
中國信託金融控股股份有限公司	727,076	398,178	2.01
台達電子工業股份有限公司	80,293	397,367	2.00
玉山金融控股股份有限公司	320,741	182,618	0.92
儒鴻企業股份有限公司	8,304	86,959	0.44
長榮航空股份有限公司	81,773	37,044	0.19
長榮海運股份有限公司	70,928	24,428	0.12
遠東新世紀股份有限公司	135,852	102,008	0.51
遠傳電信股份有限公司	64,389	144,845	0.73
豐泰企業股份有限公司	13,498	50,467	0.25
第一金融控股股份有限公司	394,039	210,291	1.06
台灣化學纖維股份有限公司	130,764	390,722	1.97
台塑石化股份有限公司	46,213	160,596	0.81
台灣塑膠工業股份有限公司	170,720	472,501	2.38
福懋興業股份有限公司	30,624	28,031	0.14
鴻準精密工業股份有限公司	38,979	103,165	0.52
富邦金融控股股份有限公司	272,922	431,879	2.18
巨大機械工業股份有限公司	12,088	68,637	0.35
興富發建設股份有限公司	33,000	46,486	0.23
上銀科技股份有限公司	8,347	38,331	0.19
鴻海精密工業股份有限公司	637,794	1,666,271	8.40
和泰汽車股份有限公司	10,172	116,462	0.59

# iShares安碩核心MSCI 台灣指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.64%)(續)	持股量	公平價值 美元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.64%)(續)</b>			
<b>台灣(99.64%)(續)</b>			
宏達國際電子股份有限公司	26,840	65,790	0.33
華南金融控股股份有限公司	309,656	156,130	0.79
群創光電	376,006	135,334	0.68
英業達股份有限公司	101,376	69,515	0.35
大立光電股份有限公司	4,048	476,028	2.40
光寶科技股份有限公司	89,347	134,732	0.68
聯發科技股份有限公司	61,188	411,034	2.07
兆豐金融控股股份有限公司	446,829	318,876	1.61
美利達工業股份有限公司	8,448	37,746	0.19
微星科技股份有限公司	28,000	63,942	0.32
南亞塑膠工業股份有限公司	194,287	429,217	2.16
南亞科技股份有限公司	27,720	41,543	0.21
億豐綜合工業股份有限公司	6,048	62,396	0.31
聯詠科技股份有限公司	23,259	76,859	0.39
浩鼎生技股份有限公司	4,488	39,687	0.20
和碩聯合科技股份有限公司	80,894	193,268	0.97
群聯電子股份有限公司	5,984	47,439	0.24
寶成	93,326	116,408	0.59
力成科技股份有限公司	26,090	70,428	0.36
統一超商股份有限公司	23,244	166,600	0.84
廣達電腦股份有限公司	110,477	206,701	1.04
瑞昱半導體股份有限公司	18,392	58,208	0.29
潤泰創新國際股份有限公司	33,792	38,585	0.20
潤泰全球股份有限公司	22,792	37,976	0.19
新光金融控股股份有限公司	349,352	85,633	0.43
矽品精密工業股份有限公司	85,485	126,919	0.64
永豐金融控股股份有限公司	421,795	118,834	0.60
佳格食品股份有限公司	16,019	38,073	0.19
聯強國際股份有限公司	57,288	57,770	0.29
中裕新藥股份有限公司	6,512	33,642	0.17
台新金融控股股份有限公司	354,071	129,636	0.65
台灣中小企業銀行股份有限公司	156,609	39,603	0.20
台灣水泥股份有限公司	139,316	151,943	0.77
合作金庫金融控股股份有限公司	311,675	135,873	0.69
台灣肥料股份有限公司	29,656	36,945	0.19
台灣大哥大股份有限公司	66,919	215,941	1.09
台灣積體電路製造股份有限公司	1,013,658	5,708,490	28.77
東元電機股份有限公司	76,690	66,389	0.34
創見資訊股份有限公司	7,832	20,705	0.11
統一企業股份有限公司	198,785	329,365	1.66
聯華電子股份有限公司	482,970	170,836	0.86

# iShares安碩核心MSCI 台灣指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.64%)(續)	持股量	公平價值 美元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.64%)(續)</b>			
<b>台灣(99.64%)(續)</b>			
世界先進積體電路股份有限公司	36,432	63,529	0.32
緯創資通股份有限公司	100,963	78,160	0.39
大聯大投資控股股份有限公司	65,308	77,002	0.39
元大金融控股股份有限公司	401,878	149,633	0.75
裕隆汽車製造股份有限公司	34,936	29,051	0.15
臻鼎科技控股股份有限公司	16,280	32,228	0.16
		<hr/>	
		19,767,905	99.64
<b>非上市供股權(0.00%)</b>			
<b>台灣(0.00%)</b>			
國泰金融控股股份有限公司－供股權	19,609	-	-
台新金融控股股份有限公司－供股權	14,508	-	-
		<hr/>	
		-	-
投資總額		19,767,905	99.64
其他資產淨值		71,539	0.36
		<hr/>	
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		19,839,444	100.00
投資總額(按成本)		<hr/>	
		19,054,818	

# iShares安碩核心MSCI 台灣指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
宏碁股份有限公司	-	267,655	-	149,295	118,360
日月光半導體製造股份有限公司	-	360,574	-	104,812	255,762
研華股份有限公司	-	18,545	-	4,785	13,760
亞洲水泥股份有限公司	-	136,680	-	35,640	101,040
亞太電信有限公司	-	117,007	-	31,911	85,096
華碩電腦股份有限公司	-	40,624	-	11,931	28,693
友達光電股份有限公司	-	493,529	-	134,607	358,922
鎧勝控股有限公司	-	7,502	-	2,046	5,456
可成科技股份有限公司	-	37,859	-	10,329	27,530
國泰金融控股股份有限公司	-	470,698	-	133,404	337,294
中租控股股份有限公司	-	59,675	-	16,269	43,406
彰化商業銀行股份有限公司	-	271,694	11,011	74,646	208,059
正新橡膠工業股份有限公司	-	112,566	-	34,392	78,174
群光電子股份有限公司	-	29,325	94	8,019	21,400
中華航空股份有限公司	-	145,805	-	39,765	106,040
中華開發金融控股股份有限公司	-	755,403	-	206,019	549,384
中國人壽保險股份有限公司	-	193,761	4,782	54,153	144,390
中國鋼鐵股份有限公司	-	676,719	-	192,987	483,732
中華電信股份有限公司	-	218,527	-	62,495	156,032
仁寶電腦工業股份有限公司	-	387,851	-	216,339	171,512
中國信託金融控股股份有限公司	-	939,357	70,180	282,461	727,076
台達電子工業股份有限公司	-	111,979	-	31,686	80,293
玉山金融控股股份有限公司	-	428,918	25,615	133,792	320,741
儒鴻企業股份有限公司	-	11,406	-	3,102	8,304
長榮航空股份有限公司	-	108,625	3,805	30,657	81,773
長榮海運股份有限公司	-	97,526	-	26,598	70,928
遠東新世紀股份有限公司	-	186,804	-	50,952	135,852
遠傳電信股份有限公司	-	149,867	-	85,478	64,389
豐泰企業股份有限公司	-	17,265	1,282	5,049	13,498
第一金融控股股份有限公司	-	525,532	16,281	147,774	394,039
台灣化學纖維股份有限公司	-	184,604	-	53,840	130,764
台塑石化股份有限公司	-	66,330	-	20,117	46,213
台灣塑膠工業股份有限公司	-	238,413	-	67,693	170,720
福懋興業股份有限公司	-	42,108	-	11,484	30,624
鴻準精密工業股份有限公司	-	52,336	503	13,860	38,979
富邦金融控股股份有限公司	-	381,603	-	108,681	272,922
巨大機械工業股份有限公司	-	16,609	-	4,521	12,088
漢民微測科技股份有限公司	-	2,541	-	2,541	-
興富發建設股份有限公司	-	45,375	-	12,375	33,000
上銀科技股份有限公司	-	11,323	159	3,135	8,347
鴻海精密工業股份有限公司	-	809,005	79,900	251,111	637,794

# iShares安碩核心MSCI 台灣指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
和泰汽車股份有限公司	-	15,093	-	4,921	10,172
宏達國際電子股份有限公司	-	36,905	-	10,065	26,840
華南金融控股股份有限公司	-	408,817	16,966	116,127	309,656
群創光電	-	517,015	-	141,009	376,006
華亞科技股份有限公司	-	145,684	-	145,684	-
英業達股份有限公司	-	139,392	-	38,016	101,376
大立光電股份有限公司	-	5,566	-	1,518	4,048
光寶科技股份有限公司	-	122,429	413	33,495	89,347
聯發科技股份有限公司	-	85,829	-	24,641	61,188
兆豐金融控股股份有限公司	-	624,977	-	178,148	446,829
美利達工業股份有限公司	-	11,616	-	3,168	8,448
微星科技股份有限公司	-	28,000	-	-	28,000
南亞塑膠工業股份有限公司	-	272,336	-	78,049	194,287
南亞科技股份有限公司	-	38,115	-	10,395	27,720
億豐綜合工業股份有限公司	-	9,527	-	3,479	6,048
聯詠科技股份有限公司	-	34,065	-	10,806	23,259
浩鼎生技股份有限公司	-	6,171	-	1,683	4,488
和碩聯合科技股份有限公司	-	111,221	-	30,327	80,894
群聯電子股份有限公司	-	8,228	-	2,244	5,984
寶成	-	128,339	-	35,013	93,326
力成科技股份有限公司	-	62,496	-	36,406	26,090
統一超商股份有限公司	-	33,261	-	10,017	23,244
廣達電腦股份有限公司	-	155,966	-	45,489	110,477
瑞昱半導體股份有限公司	-	50,578	-	32,186	18,392
潤泰創新國際股份有限公司	-	46,464	-	12,672	33,792
潤泰全球股份有限公司	-	53,613	-	30,821	22,792
新光金融控股股份有限公司	-	473,234	-	123,882	349,352
矽品精密工業股份有限公司	-	202,004	-	116,519	85,485
新普科技股份有限公司	-	15,367	-	15,367	-
永豐金融控股股份有限公司	-	560,907	19,057	158,169	421,795
佳格食品股份有限公司	-	20,474	1,551	6,006	16,019
聯強國際股份有限公司	-	76,105	2,666	21,483	57,288
中裕新藥股份有限公司	-	8,954	-	2,442	6,512
台新金融控股股份有限公司	-	463,514	23,349	132,792	354,071
台灣中小企業銀行股份有限公司	-	205,095	10,254	58,740	156,609
台灣水泥股份有限公司	-	191,555	-	52,239	139,316
合作金庫金融控股股份有限公司	-	430,627	19,878	138,830	311,675
台灣肥料股份有限公司	-	40,777	-	11,121	29,656
台灣大哥大股份有限公司	-	96,167	-	29,248	66,919
台灣積體電路製造股份有限公司	-	1,416,508	-	402,850	1,013,658
東元電機股份有限公司	-	116,633	-	39,943	76,690

# iShares安碩核心MSCI 台灣指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
創見資訊股份有限公司	-	10,769	-	2,937	7,832
統一企業股份有限公司	-	279,329	-	80,544	198,785
聯華電子股份有限公司	-	691,166	-	208,196	482,970
世界先進積體電路股份有限公司	-	50,094	-	13,662	36,432
緯創資通股份有限公司	-	135,949	2,865	37,851	100,963
大聯大投資控股股份有限公司	-	89,794	-	24,486	65,308
元大金融控股股份有限公司	-	552,589	-	150,711	401,878
裕隆汽車製造股份有限公司	-	48,037	-	13,101	34,936
臻鼎科技控股股份有限公司	-	22,385	-	6,105	16,280
<b>期貨</b>					
MSCI 台灣指數—二零一六年七月	-	6	-	6	-
<b>非上市供股權</b>					
國泰金融控股股份有限公司—供股權	-	-	39,218	19,609	19,609
台新金融控股股份有限公司—供股權	-	-	29,016	14,508	14,508

# iShares安碩核心MSCI 台灣指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 美元	成分基金交易 資產淨值 美元
截至下列日期財務期間結束時 二零一六年十二月三十一日	1.13	19,839,608

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 美元	最低每單位 資產淨值 美元
截至下列日期止財務期間 二零一六年十二月三十一日(自成立以來)	1.20	1.01

# iShares安碩德國DAX指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.85%)	持股量	公平價值 歐元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.85%)</b>			
<b>德國(99.85%)</b>			
Adidas AG	1,205	180,931	2.98
Allianz Se - Reg	2,952	463,464	7.63
BASF SE	5,945	525,003	8.65
Bayer AG - Reg	5,365	531,833	8.76
Bayerische Motoren Werke AG	2,088	185,310	3.05
Beiersdorf AG	638	51,423	0.85
Commerzbank AG	6,844	49,592	0.82
Continental AG	696	127,855	2.11
Daimler AG - 登記股份	6,467	457,346	7.53
Deutsche Bank AG - Registered	8,845	152,576	2.51
Deutsche Boerse AG - Tender	1,083	83,976	1.38
Deutsche Lufthansa - Reg	3,016	37,006	0.61
Deutsche Post AG - Reg	6,033	188,441	3.10
Deutsche Telekom AG - Reg	20,532	335,801	5.53
E.ON SE	12,644	84,715	1.40
Fresenius Medical Care AG	1,363	109,653	1.81
Fresenius SE & Co KGaA	2,610	193,819	3.19
Heidelbergcement AG	961	85,173	1.40
Henkel AG & Co KGaA Vorzug	1,131	128,086	2.11
Infineon Technologies AG	7,279	120,176	1.98
Linde AG	1,204	187,944	3.09
Merck KGaA	841	83,385	1.37
Muenchener Rueckver AG - Reg	1,021	183,423	3.02
ProSiebenSat.1 Media SE	1,485	54,366	0.90
RWE AG	3,132	37,005	0.61
SAP SE	6,277	519,798	8.56
Siemens AG - Reg	5,118	597,782	9.84
Thyssenkrupp AG	2,813	63,686	1.05
Volkswagen AG - 優先股	1,189	158,553	2.61
Vonovia SE	2,755	85,143	1.40
投資總額		6,063,264	99.85
其他資產淨值		9,254	0.15
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		6,072,518	100.00
投資總額(按成本)		5,420,792	

# iShares安碩德國DAX指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
Adidas AG	-	1,935	-	730	1,205
Allianz Se - Reg	-	4,380	-	1,428	2,952
BASF SE	-	8,815	-	2,870	5,945
Bayer AG - Reg	-	7,955	-	2,590	5,365
Bayerische Motoren Werke AG	-	3,096	-	1,008	2,088
Beiersdorf AG	-	946	-	308	638
Commerzbank AG	-	10,148	-	3,304	6,844
Continental AG	-	1,032	-	336	696
Daimler AG - 登記股份	-	9,589	-	3,122	6,467
Deutsche Bank AG - Registered	-	13,115	-	4,270	8,845
Deutsche Boerse AG	-	1,806	-	1,806	-
Deutsche Boerse AG - Tender	-	1,806	-	723	1,083
Deutsche Lufthansa - Reg	-	4,472	-	1,456	3,016
Deutsche Post AG - Reg	-	9,202	-	3,169	6,033
Deutsche Telekom AG - Reg	-	30,444	-	9,912	20,532
E.ON SE	-	37,496	-	24,852	12,644
Fresenius Medical Care AG	-	2,021	-	658	1,363
Fresenius SE & Co KGaA	-	3,870	-	1,260	2,610
Heidelbergcement AG	-	1,423	-	462	961
Henkel AG & Co KGaA Vorzug	-	1,677	-	546	1,131
Infineon Technologies AG	-	10,793	-	3,514	7,279
Linde AG	-	1,770	-	566	1,204
Merck KGaA	-	1,247	-	406	841
Muenchener Rueckver AG - Reg	-	1,548	-	527	1,021
ProSiebenSat.1 Media SE	-	2,181	-	696	1,485
RWE AG	-	4,644	-	1,512	3,132
SAP SE	-	9,289	-	3,012	6,277
Siemens AG - Reg	-	7,781	-	2,663	5,118
Thyssenkrupp AG	-	4,171	-	1,358	2,813
Uniper SE	-	1,874	-	1,874	-
Volkswagen AG - 優先股	-	1,763	-	574	1,189
Vonovia SE	-	4,085	-	1,330	2,755

# iShares安碩德國DAX指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 歐元	成分基金交易 資產淨值 歐元
截至下列日期財務期間結束時 二零一六年十二月三十一日	1.05	6,072,552

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 歐元	最低每單位 資產淨值 歐元
截至下列日期止財務期間 二零一六年十二月三十一日(自成立以來)	1.05	0.85

# iShares安碩歐元區STOXX 50指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.56%)	持股量	公平價值 歐元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.56%)</b>			
<b>比利時(3.26%)</b>			
Anheuser-Busch Inbev SA/NV	1,656	166,511	3.26
		166,511	3.26
<b>芬蘭(1.20%)</b>			
Nokia OYJ	13,311	61,071	1.20
		61,071	1.20
<b>法國(36.35%)</b>			
Air Liquide SA	900	95,085	1.87
Airbus SE	1,306	82,069	1.61
AXA SA	4,772	114,456	2.24
BNP Paribas	2,559	154,948	3.04
Compagnie De Saint Gobain	1,189	52,619	1.03
Danone	1,396	84,039	1.65
Engie	3,720	45,086	0.88
Essilor International	500	53,675	1.05
L'Oreal	558	96,757	1.90
LVMH Moet Hennessy Louis Vui	625	113,375	2.22
Orange	4,589	66,242	1.30
Safran SA	813	55,626	1.09
Sanofi	2,687	206,630	4.05
Schneider Electric SE	1,343	88,786	1.74
Societe Generale SA	1,836	85,824	1.68
Total SA	5,812	283,161	5.55
Unibail-Rodamco SE	225	51,019	1.00
Vinci SA	1,276	82,557	1.62
Vivendi	2,338	42,213	0.83
		1,854,167	36.35
<b>德國(33.50%)</b>			
Adidas AG	442	66,366	1.30
Allianz SE - Reg	1,046	164,222	3.22
BASF SE	2,112	186,511	3.66
Bayer AG - Reg	1,893	187,653	3.68
Bayerische Motoren Werke AG	728	64,610	1.27
Daimler AG - 登記股份	2,286	161,666	3.17
Deutsche Bank AG - Registered	3,159	54,493	1.07
Deutsche Post AG - Reg	2,188	68,342	1.34
Deutsche Telekom AG - Reg	7,268	118,868	2.33
E.On SE	4,700	31,490	0.62
Fresenius SE & Co KGaA	912	67,725	1.33
Muenchener Rueckver AG - Reg	364	65,392	1.28

# iShares安碩歐元區STOXX 50指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.56%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.56%)(續)</b>			
<b>德國(33.50%)(續)</b>			
Sap SE	2,264	187,482	3.67
Siemens AG - Reg	1,946	227,293	4.45
Volkswagen AG - Pref	425	56,674	1.11
		1,708,787	33.50
<b>愛爾蘭(1.23%)</b>			
CRH Plc	1,904	62,746	1.23
		62,746	1.23
<b>意大利(4.79%)</b>			
Enel Spa	17,783	74,475	1.46
Eni Spa	5,811	89,896	1.76
Intesa Sanpaolo	32,889	79,789	1.57
		244,160	4.79
<b>荷蘭(9.24%)</b>			
ASML Holding NV	845	90,119	1.77
ING Groep NV	8,911	119,140	2.33
Koninklijke Ahold Delhaize N	2,937	58,828	1.15
Koninklijke Philips NV	2,175	63,075	1.24
Unilever NV - CVA	3,589	140,384	2.75
		471,546	9.24
<b>西班牙(9.99%)</b>			
Banco Bilbao Vizcaya Argenta	15,099	96,845	1.90
Banco Santander SA	33,389	165,576	3.25
Iberdrola SA	13,138	81,902	1.61
Industria De Diseno Textil	2,398	77,767	1.52
Telefonica SA	9,915	87,451	1.71
		509,541	9.99
投資總額		5,078,529	99.56
其他資產淨值		22,311	0.44
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		5,100,840	100.00
投資總額(按成本)		4,652,369	

# iShares安碩歐元區STOXX 50指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
Adidas AG	-	766	-	324	442
Air Liquide SA	-	1,548	-	648	900
Airbus SE	-	2,322	-	1,016	1,306
Allianz SE-Reg	-	1,849	-	803	1,046
Anheuser-Busch Inbev SA/NV	-	6,123	-	4,467	1,656
ASML Holding NV	-	1,505	-	660	845
Assicurazioni Generali	-	5,461	-	5,461	-
AXA SA	-	8,385	-	3,613	4,772
Banco Bilbao Vizcaya Argenta	-	26,531	-	11,432	15,099
Banco Santander SA	-	58,874	-	25,485	33,389
BASF SE	-	3,698	-	1,586	2,112
Bayer AG - Reg	-	3,354	-	1,461	1,893
Bayerische Motoren Werke AG	-	1,290	-	562	728
BNP Paribas	-	4,515	-	1,956	2,559
Carrefour SA	-	2,193	-	2,193	-
Compagnie De Saint Gobain	-	2,107	-	918	1,189
CRH Plc	-	3,272	-	1,368	1,904
Daimler AG –登記股份	-	3,999	-	1,713	2,286
Danone	-	2,451	-	1,055	1,396
Deutsche Bank AG - Registered	-	5,547	-	2,388	3,159
Deutsche Post AG - Reg	-	3,870	-	1,682	2,188
Deutsche Telekom AG - Reg	-	12,771	-	5,503	7,268
E.On SE	-	16,168	-	11,468	4,700
Enel Spa	-	31,347	-	13,564	17,783
Engie	-	6,622	-	2,902	3,720
Eni Spa	-	10,234	-	4,423	5,811
Essilor International	-	860	-	360	500
Fresenius SE & Co KGaA	-	1,634	-	722	912
Iberdrola SA	-	23,252	-	10,114	13,138
Industria De Diseno Textil	-	4,257	-	1,859	2,398
ING Groep NV	-	15,652	-	6,741	8,911
Intesa Sanpaolo	-	58,007	-	25,118	32,889
Koninklijke Ahold Delhaize N	-	5,052	-	2,115	2,937
Koninklijke Philips NV	-	3,741	-	1,566	2,175
L'Oreal	-	989	-	431	558
LVMH Moet Hennessy Louis Vui	-	1,075	-	450	625
Muenchener Rueckver AG - Reg	-	645	-	281	364
Nokia OYJ	-	23,521	-	10,210	13,311
Orange	-	8,041	-	3,452	4,589
Safran SA	-	1,419	-	606	813
Sanofi	-	4,730	-	2,043	2,687

# iShares安碩歐元區STOXX 50指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Sap SE	-	3,956	-	1,692	2,264
Schneider Electric SE	-	2,365	-	1,022	1,343
Siemens AG - Reg	-	3,369	-	1,423	1,946
Societe Generale SA	-	3,268	-	1,432	1,836
Telefonica SA	-	18,542	-	8,627	9,915
Total SA	-	10,129	-	4,317	5,812
Unibail-Rodamco SE	-	387	-	162	225
Unicredit Spa	-	23,650	-	23,650	-
Unilever NV - CVA	-	6,278	-	2,689	3,589
Uniper SE	-	808	-	808	-
Vinci SA	-	2,236	-	960	1,276
Vivendi	-	4,730	-	2,392	2,338
Volkswagen AG - Pref	-	731	-	306	425
<b>上市供股權</b>					
Air Liquide SA – 供股權	-	-	1,376	1,376	-
Banco Bilbao Vizcaya Argenta – 供股權	-	-	25,584	25,584	-
Banco Santander SA – 供股權	-	-	56,781	56,781	-
Iberdrola SA – 供股權	-	-	22,747	22,747	-
Telefonica SA – 供股權	-	-	17,426	17,426	-

# iShares安碩歐元區STOXX 50指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 歐元	成分基金交易 資產淨值 歐元
截至下列日期財務期間結束時 二零一六年十二月三十一日	1.02	5,100,868

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 歐元	最低每單位 資產淨值 歐元
截至下列日期止財務期間 二零一六年十二月三十一日(自成立以來)	1.02	0.83

# iShares安碩富時100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.37%)	持股量	公平價值 英鎊	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.36%)</b>			
<b>澳洲(2.12%)</b>			
Rio Tinto Plc	2,675	84,490	2.12
		84,490	2.12
<b>智利(0.13%)</b>			
Antofagasta Plc	744	5,022	0.13
		5,022	0.13
<b>德國(0.29%)</b>			
TUI AG - Di	984	11,444	0.29
		11,444	0.29
<b>愛爾蘭(3.07%)</b>			
CRH Plc	1,838	52,015	1.30
DCC Plc	192	11,597	0.29
Experian Plc	2,126	33,463	0.84
Paddy Power Betfair Plc	180	15,795	0.40
Smurfit Kappa Group Plc	518	9,759	0.24
		122,629	3.07
<b>約旦(0.14%)</b>			
Hikma Pharmaceuticals Plc	288	5,452	0.14
		5,452	0.14
<b>馬里(0.35%)</b>			
Randgold Resources Ltd	219	14,049	0.35
		14,049	0.35
<b>墨西哥(0.11%)</b>			
Fresnillo Plc	360	4,396	0.11
		4,396	0.11
<b>荷蘭(10.29%)</b>			
Royal Dutch Shell Plc - A Shs	9,634	216,042	5.41
Royal Dutch Shell Plc - B Shs	8,265	194,558	4.88
		410,600	10.29
<b>南非(1.00%)</b>			
Anglo American Plc	2,890	33,524	0.84
Mediclinic International Plc	840	6,476	0.16
		40,000	1.00

# iShares安碩富時100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.37%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.36%)(續)</b>			
<b>瑞士(2.67%)</b>			
Coca-Cola HBC AG - Di	408	7,222	0.18
Glencore Plc	25,748	71,412	1.79
Wolseley Plc	561	27,837	0.70
		106,471	2.67
<b>英國(79.19%)</b>			
3I Group Plc	2,075	14,608	0.37
Admiral Group Plc	432	7,893	0.20
Ashtead Group Plc	1,171	18,502	0.46
Associated British Foods Plc	744	20,423	0.51
Astrazeneca Plc	2,789	123,762	3.10
Aviva Plc	8,939	43,479	1.09
Babcock Intl Group Plc	1,056	10,064	0.25
BAE Systems Plc	6,986	41,322	1.04
Barclays Plc	37,352	83,463	2.09
Barratt Developments Plc	2,112	9,766	0.24
BHP Billiton Plc	4,665	60,948	1.53
BP Plc	41,099	209,441	5.25
British American Tobacco Plc	4,113	190,082	4.77
British Land Co Plc	2,160	13,597	0.34
BT Group Plc	18,481	67,807	1.70
Bunzl Plc	792	16,703	0.42
Burberry Group Plc	936	14,012	0.35
Capita Plc	1,392	7,392	0.19
Carnival Plc	384	15,840	0.40
Centrica Plc	12,461	29,171	0.73
Compass Group Plc	3,637	54,591	1.37
Convatec Group Plc	1,274	2,980	0.07
Croda International Plc	287	9,173	0.23
Diageo Plc	5,558	117,274	2.94
Direct Line Insurance Group	2,904	10,727	0.27
Dixons Carphone Plc	2,112	7,489	0.19
Easyjet Plc	528	5,306	0.13
GKN Plc	3,624	12,021	0.30
Glaxosmithkline Plc	10,738	167,728	4.21
Hammerson Plc	1,656	9,489	0.24
Hargreaves Lansdown Plc	612	7,424	0.19
滙豐控股有限公司	44,051	289,371	7.25
Imperial Brands Plc	2,145	75,987	1.91
Informa Plc	1,781	12,111	0.30
Intercontinental Hotels Grou	468	17,026	0.43

# iShares安碩富時100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.37%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
上市股本(99.36%)(續)			
英國(79.19%)(續)			
Intertek Group Plc	336	11,696	0.29
Intl Consolidated Airline - Di	3,672	16,190	0.41
Intu Properties Plc	1,992	5,604	0.14
ITV Plc	7,944	16,396	0.41
Johnson Matthey Plc	408	12,983	0.33
Kingfisher Plc	4,824	16,898	0.42
Land Securities Group Plc	1,656	17,653	0.44
Legal & General Group Plc	13,115	32,473	0.81
Lloyds Banking Group Plc	141,348	88,357	2.22
London Stock Exchange Group	672	19,582	0.49
Marks & Spencer Group Plc	3,432	12,012	0.30
Merlin Entertainment	1,512	6,783	0.17
Micro Focus International	471	10,263	0.26
Mondi Plc	768	12,795	0.32
National Grid Plc	8,332	79,287	1.99
Next Plc	312	15,547	0.39
Old Mutual Plc	10,368	21,493	0.54
Pearson Plc	1,752	14,340	0.36
Persimmon Plc	648	11,509	0.29
Provident Financial Plc	312	8,889	0.22
Prudential Plc	5,702	92,800	2.33
Reckitt Benckiser Group Plc	1,386	95,440	2.39
Relx Plc	2,419	35,051	0.88
Rolls-Royce Holdings Plc	3,802	25,397	0.64
Royal Bank of Scotland Group	6,936	15,578	0.39
Royal Mail Plc	1,920	8,872	0.22
RSA Insurance Group Plc	2,160	12,658	0.32
Sage Group Plc/The	2,280	14,934	0.37
Sainsbury (J) Plc	4,043	10,079	0.25
Schroders Plc	240	7,195	0.18
Severn Trent Plc	504	11,199	0.28
Shire Plc	1,985	92,977	2.33
Sky Plc	2,232	22,119	0.55
Smith & Nephew Plc	1,878	22,930	0.57
Smiths Group Plc	828	11,724	0.29
SSE Plc	2,220	34,477	0.86
St James's Place Plc	1,104	11,195	0.28
渣打集團有限公司	5,928	39,338	0.99
Standard Life Plc	4,152	15,445	0.39
Taylor Wimpey Plc	6,912	10,610	0.27
Tesco Plc	17,942	37,113	0.93

# iShares安碩富時100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.37%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.36%)(續)</b>			
<b>英國(79.19%)(續)</b>			
Unilever Plc	2,665	87,745	2.20
United Utilities Group Plc	1,440	12,974	0.33
Vodafone Group Plc	58,662	117,236	2.94
Whitbread Plc	384	14,500	0.36
WM Morrison Supermarkets	4,584	10,575	0.27
Worldpay Group Plc	3,585	9,676	0.24
WPP Plc	2,821	51,229	1.28
		3,158,788	79.19
總上市股本		3,963,341	99.36
<b>非上市股本(0.01%)</b>			
<b>英國(0.01%)</b>			
Rolls-Royce Holdings - Entitl	313,260	313	0.01
非上市股本總額		313	0.01
投資總額		3,963,654	99.37
其他資產淨值		25,048	0.63
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		3,988,702	100.00
投資總額(按成本)		3,526,605	

# iShares安碩富時100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
3I Group Plc	-	3,728	-	1,653	2,075
Admiral Group Plc	-	1,548	-	1,116	432
Anglo American Plc	-	5,170	-	2,280	2,890
Antofagasta Plc	-	1,333	-	589	744
Arm Holdings Plc	-	5,375	-	5,375	-
Ashtead Group Plc	-	2,102	-	931	1,171
Associated British Foods Plc	-	1,333	-	589	744
Astrazeneca Plc	-	5,063	-	2,274	2,789
Aviva Plc	-	16,007	-	7,068	8,939
Babcock Intl Group Plc	-	1,892	-	836	1,056
BAE Systems Plc	-	12,515	-	5,529	6,986
Barclays Plc	-	66,929	-	29,577	37,352
Barratt Developments Plc	-	3,784	-	1,672	2,112
Berkeley Group Holdings/The	-	473	-	473	-
BHP Billiton Plc	-	8,357	-	3,692	4,665
BP Plc	-	75,675	-	34,576	41,099
British American Tobacco Plc	-	7,375	-	3,262	4,113
British Land Co Plc	-	3,870	-	1,710	2,160
BT Group Plc	-	33,111	-	14,630	18,481
Bunzl Plc	-	1,419	-	627	792
Burberry Group Plc	-	1,677	-	741	936
Capita Plc	-	2,494	-	1,102	1,392
Carnival Plc	-	688	-	304	384
Centrica Plc	-	22,322	-	9,861	12,461
Coca-Cola HBC AG - Di	-	1,462	-	1,054	408
Compass Group Plc	-	6,519	-	2,882	3,637
Convatec Group Plc	-	1,592	-	318	1,274
CRH Plc	-	3,282	-	1,444	1,838
Croda International Plc	-	515	-	228	287
DCC Plc	-	344	-	152	192
Diageo Plc	-	9,966	-	4,408	5,558
Direct Line Insurance Group	-	5,203	-	2,299	2,904
Dixons Carphone Plc	-	3,784	-	1,672	2,112
Easyjet Plc	-	946	-	418	528
Experian Plc	-	3,798	-	1,672	2,126
Fresnillo Plc	-	645	-	285	360
GKN Plc	-	6,493	-	2,869	3,624
Glaxosmithkline Plc	-	19,467	-	8,729	10,738
Glencore Plc	-	46,135	-	20,387	25,748
Hammerson Plc	-	2,967	-	1,311	1,656
Hargreaves Lansdown Plc	-	1,100	-	488	612

# iShares安碩富時100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Hikma Pharmaceuticals Plc	-	516	-	228	288
滙豐控股有限公司	-	78,669	-	34,618	44,051
Imperial Brands Plc	-	3,842	-	1,697	2,145
Informa Plc	-	3,187	-	1,406	1,781
Intercontinental Hotels Group	-	835	-	367	468
Intertek Group Plc	-	602	-	266	336
Intl Consolidated Airline - Di	-	13,158	-	9,486	3,672
Intu Properties Plc	-	3,569	-	1,577	1,992
ITV Plc	-	14,233	-	6,289	7,944
Johnson Matthey Plc	-	731	-	323	408
Kingfisher Plc	-	8,643	-	3,819	4,824
Land Securities Group Plc	-	2,967	-	1,311	1,656
Legal & General Group Plc	-	23,495	-	10,380	13,115
Lloyds Banking Group Plc	-	253,258	-	111,910	141,348
London Stock Exchange Group	-	1,204	-	532	672
Marks & Spencer Group Plc	-	6,149	-	2,717	3,432
Mediclinic International Plc	-	1,505	-	665	840
Merlin Entertainment	-	2,709	-	1,197	1,512
Micro Focus International	-	851	-	380	471
Mondi Plc	-	1,376	-	608	768
National Grid Plc	-	14,925	-	6,593	8,332
Next Plc	-	559	-	247	312
Old Mutual Plc	-	18,576	-	8,208	10,368
Paddy Power Betfair Plc	-	332	-	152	180
Pearson Plc	-	3,139	-	1,387	1,752
Persimmon Plc	-	1,161	-	513	648
Polymetal International Plc	-	994	-	994	-
Provident Financial Plc	-	559	-	247	312
Prudential Plc	-	10,205	-	4,503	5,702
Randgold Resources Ltd	-	344	-	125	219
Reckitt Benckiser Group Plc	-	2,539	-	1,153	1,386
Relx Plc	-	4,338	-	1,919	2,419
Rio Tinto Plc	-	4,784	-	2,109	2,675
Rolls-Royce Holdings Plc	-	6,810	-	3,008	3,802
Royal Bank of Scotland Group	-	12,427	-	5,491	6,936
Royal Dutch Shell Plc - A Shs	-	17,442	-	7,808	9,634
Royal Dutch Shell Plc - B Shs	-	14,820	-	6,555	8,265
Royal Mail Plc	-	3,440	-	1,520	1,920
RSA Insurance Group Plc	-	3,870	-	1,710	2,160
SabMiller Plc	-	3,712	-	3,712	-
Sage Group Plc/The	-	4,085	-	1,805	2,280

# iShares安碩富時100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Sainsbury (J) Plc	-	7,248	-	3,205	4,043
Schroders Plc	-	430	-	190	240
Severn Trent Plc	-	903	-	399	504
Shire Plc	-	3,620	-	1,635	1,985
Sky Plc	-	3,999	-	1,767	2,232
Smith & Nephew Plc	-	3,697	-	1,819	1,878
Smiths Group Plc	-	1,480	-	652	828
Smurfit Kappa Group Plc	-	644	-	126	518
SSE Plc	-	3,981	-	1,761	2,220
St James's Place Plc	-	1,978	-	874	1,104
渣打集團有限公司	-	10,621	-	4,693	5,928
Standard Life Plc	-	7,439	-	3,287	4,152
Taylor Wimpey Plc	-	12,384	-	5,472	6,912
Tesco Plc	-	32,141	-	14,199	17,942
Travis Perkins Plc	-	946	-	946	-
TUI AG - Di	-	1,763	-	779	984
Unilever Plc	-	4,774	-	2,109	2,665
United Utilities Group Plc	-	2,580	-	1,140	1,440
Vodafone Group Plc	-	105,117	-	46,455	58,662
Whitbread Plc	-	688	-	304	384
WM Morrison Supermarkets	-	8,213	-	3,629	4,584
Wolseley Plc	-	998	-	437	561
Worldpay Group Plc	-	6,422	-	2,837	3,585
WPP Plc	-	5,050	-	2,229	2,821
<b>上市供股權</b>					
Informa Plc – 供股權	-	-	612	612	-
<b>非上市股本</b>					
Rolls-Royce Holdings - Entitl	-	-	313,260	-	313,260

# iShares安碩富時100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 英鎊	成分基金交易 資產淨值 英鎊
截至下列日期財務期間結束時 二零一六年十二月三十一日	0.83	3,988,724

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 英鎊	最低每單位 資產淨值 英鎊
截至下列日期止財務期間 二零一六年十二月三十一日(自成立以來)	0.83	0.69

# iShares安碩納斯達克100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)	持股量	公平價值 美元	資產淨值 百分比
<b>上市股本(99.71%)</b>			
<b>中國(1.77%)</b>			
百度股份有限公司 – Spon ADR	374	61,489	0.78
攜程旅行網 – ADR	580	23,200	0.30
京東商城電子商務有限公司 – ADR	1,258	32,004	0.41
網易公司 – ADR	102	21,965	0.28
		138,658	1.77
<b>愛爾蘭(0.20%)</b>			
Seagate Technology	408	15,573	0.20
		15,573	0.20
<b>以色列(0.26%)</b>			
Check Point Software Tech	238	20,101	0.26
		20,101	0.26
<b>荷蘭(0.59%)</b>			
NXP Semiconductors NV	476	46,653	0.59
		46,653	0.59
<b>新加坡(1.23%)</b>			
Broadcom Ltd	544	96,163	1.23
		96,163	1.23
<b>英國(0.98%)</b>			
Liberty Global Plc - A	408	12,481	0.16
Liberty Global Plc - Series C	918	27,265	0.35
Liberty Global Plc Lilac - C	167	3,535	0.04
Shire Plc - ADR	120	20,446	0.26
Vodafone Group Plc - SP ADR	544	13,290	0.17
		77,017	0.98
<b>美國(94.68%)</b>			
Activision Blizzard Inc	1,020	36,832	0.47
Adobe Systems Inc	680	70,006	0.89
Akamai Technologies Inc	238	15,870	0.20
Alexion Pharmaceuticals Inc	306	37,439	0.48
Alphabet Inc - Cl A	408	323,320	4.12
Alphabet Inc - Cl C	476	367,386	4.68
Amazon.Com Inc	659	494,164	6.30
American Airlines Group Inc	727	33,944	0.43
Amgen Inc	1,034	151,181	1.93
Analog Devices Inc	442	32,098	0.41
Apple Inc	7,370	853,593	10.88

# iShares安碩納斯達克100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
上市股本(99.71%)(續)			
美國(94.68%)(續)			
Applied Materials Inc	1,496	48,276	0.61
Autodesk Inc	306	22,647	0.29
Automatic Data Processing	646	66,396	0.85
Biogen Inc	306	86,775	1.11
Biomarin Pharmaceutical Inc	238	19,716	0.25
CA Inc	578	18,363	0.23
Celgene Corp	1,088	125,936	1.60
Cerner Corp	476	22,548	0.29
Charter Communications Inc - A	374	107,682	1.37
Cintas Corp	147	16,987	0.22
Cisco Systems Inc	6,970	210,633	2.68
Citrix Systems Inc	204	18,219	0.23
Cognizant Tech Solutions - A	850	47,625	0.61
Comcast Corp -A類	3,294	227,451	2.90
Costco Wholesale Corp	612	97,987	1.25
CSX Corp	1,326	47,643	0.61
Dentsply Sirona Inc	340	19,628	0.25
Discovery Communications - A	204	5,592	0.07
Discovery Communications - C	340	9,105	0.12
Dish Network Corp - A	306	17,727	0.23
Dollar Tree Inc	340	26,241	0.33
Ebay Inc	1,598	47,445	0.60
Electronic Arts Inc	408	32,134	0.41
Expedia Inc	204	23,109	0.29
Express Scripts Holding Co	884	60,810	0.78
Facebook Inc - A	3,228	371,381	4.73
Fastenal Co	408	19,168	0.24
Fiserv Inc	306	32,522	0.41
Gilead Sciences Inc	1,836	131,476	1.68
Hasbro Inc	173	13,458	0.17
Henry Schein Inc	115	17,447	0.22
Hologic Inc	387	15,526	0.20
Illumina Inc	204	26,120	0.33
Incyte Corp	272	27,273	0.35
Intel Corp	6,581	238,693	3.04
Intuit Inc	353	40,457	0.52
Intuitive Surgical Inc	50	31,708	0.40
KLA - Tencor Corp	219	17,231	0.22
Kraft Heinz Co/The	1,700	148,444	1.89
Lam Research Corp	238	25,164	0.32
Liberty Interactive Corp Q - A	612	12,228	0.16

# iShares安碩納斯達克100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
上市股本(99.71%)(續)			
美國(94.68%)(續)			
Liberty Ventures - Ser A	119	4,388	0.06
Marriott International - CI A	540	44,647	0.57
Mattel Inc	476	13,114	0.17
Maxim Integrated Products	408	15,737	0.20
Microchip Technology Inc	290	18,603	0.24
Micron Technology Inc	1,428	31,302	0.40
Microsoft Corp	10,750	668,005	8.51
Mondelez International Inc - A	2,142	94,955	1.21
Monster Beverage Corp	816	36,181	0.46
Mylan NV	714	27,239	0.35
Netflix Inc	591	73,166	0.93
Norwegian Cruise Line Holdin	306	13,014	0.17
Nvidia Corp	748	79,842	1.02
O'Reilly Automotive Inc	136	37,864	0.48
Paccar Inc	476	30,416	0.39
Paychex Inc	510	31,049	0.40
Paypal Holdings Inc	1,666	65,757	0.84
Priceline Group Inc/The	68	99,692	1.27
Qualcomm Inc	2,040	133,008	1.70
Regeneron Pharmaceuticals	150	55,064	0.70
Ross Stores Inc	544	35,686	0.45
SBA Communications Corp - CI A	170	17,554	0.22
Sirius XM Holdings Inc	6,868	30,563	0.39
Skyworks Solutions Inc	272	20,308	0.26
Starbucks Corp	2,040	113,261	1.44
Symantec Corp	850	20,307	0.26
Tesla Motors Inc	204	43,593	0.56
Texas Instruments Inc	1,394	101,720	1.30
T-Mobile US Inc	1,122	64,526	0.82
Tractor Supply Company	170	12,888	0.16
Tripadvisor Inc	170	7,883	0.10
Twenty-First Century Fox - A	1,530	42,901	0.55
Twenty-First Century Fox - B	1,122	30,575	0.39
Ulta Salon Cosmetics & Fragr	82	20,905	0.27
Verisk Analytics Inc	238	19,318	0.25
Vertex Pharmaceuticals Inc	340	25,048	0.32
Viacom Inc - B類	476	16,708	0.21
Walgreens Boots Alliance Inc	1,496	123,809	1.58
Western Digital Corp	374	25,413	0.32
Xilinx Inc	340	20,526	0.26

# iShares安碩納斯達克100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合(未經審核)(續)

於二零一六年十二月三十一日

投資(99.71%)(續)	持股量	公平價值 港元	資產淨值 百分比
上市股本(99.71%)(續)			
美國(94.68%)(續)			
Yahoo! Inc	1,326	51,276	0.65
		7,428,615	94.68
投資總額		7,822,780	99.71
其他資產淨值		23,089	0.29
基金單位持有人於二零一六年十二月三十一日 應佔的資產淨值		7,845,869	100.00
投資總額(按成本)		7,100,642	

# iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF

(iShares 安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本</b>					
Activision Blizzard Inc	-	1,860	-	840	1,020
Adobe Systems Inc	-	1,240	-	560	680
Akamai Technologies Inc	-	434	-	196	238
Alexion Pharmaceuticals Inc	-	558	-	252	306
Alphabet Inc - Cl A	-	744	-	336	408
Alphabet Inc - Cl C	-	868	-	392	476
Amazon.Com Inc	-	1,202	-	543	659
American Airlines Group Inc	-	1,488	-	761	727
Amgen Inc	-	1,922	-	888	1,034
Analog Devices Inc	-	806	-	364	442
Apple Inc	-	13,826	-	6,456	7,370
Applied Materials Inc	-	2,728	-	1,232	1,496
Autodesk Inc	-	558	-	252	306
Automatic Data Processing	-	1,178	-	532	646
百度股份有限公司－Spon ADR	-	682	-	308	374
Bed Bath & Beyond Inc	-	372	-	372	-
Biogen Inc	-	558	-	252	306
Biomarin Pharmaceutical Inc	-	434	-	196	238
Broadcom Ltd	-	992	-	448	544
CA Inc	-	1,054	-	476	578
Celgene Corp	-	1,984	-	896	1,088
Cerner Corp	-	868	-	392	476
Charter Communications Inc - A	-	682	-	308	374
Check Point Software Tech	-	434	-	196	238
Cintas Corp	-	179	-	32	147
Cisco Systems Inc	-	12,710	-	5,740	6,970
Citrix Systems Inc	-	372	-	168	204
Cognizant Tech Solutions - A	-	1,550	-	700	850
Comcast Corp - A 類	-	6,076	-	2,782	3,294
Commercehub Inc - Series A	-	37	-	37	-
Commercehub Inc - Series C	-	74	-	74	-
Costco Wholesale Corp	-	1,116	-	504	612
CSX Corp	-	2,418	-	1,092	1,326
攜程旅行網－ADR	-	1,016	-	436	580
Dentsply Sirona Inc	-	620	-	280	340
Discovery Communications - A	-	372	-	168	204
Discovery Communications - C	-	620	-	280	340
Dish Network Corp - A	-	558	-	252	306
Dollar Tree Inc	-	620	-	280	340
Ebay Inc	-	2,914	-	1,316	1,598

# iShares安碩納斯達克100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
Electronic Arts Inc	-	744	-	336	408
Endo International Plc	-	558	-	558	-
Expedia Inc	-	372	-	168	204
Express Scripts Holding Co	-	1,612	-	728	884
Facebook Inc - A	-	5,888	-	2,660	3,228
Fastenal Co	-	744	-	336	408
Fiserv Inc	-	558	-	252	306
Gilead Sciences Inc	-	3,348	-	1,512	1,836
Hasbro Inc	-	213	-	40	173
Henry Schein Inc	-	207	-	92	115
Hologic Inc	-	475	-	88	387
Illumina Inc	-	372	-	168	204
Incyte Corp	-	496	-	224	272
Intel Corp	-	11,993	-	5,412	6,581
Intuit Inc	-	649	-	296	353
Intuitive Surgical Inc	-	124	-	74	50
京東商城電子商務有限公司-ADR	-	2,294	-	1,036	1,258
KLA - Tencor Corp	-	267	-	48	219
Kraft Heinz Co/The	-	3,100	-	1,400	1,700
Lam Research Corp	-	434	-	196	238
Liberty Expedia Hold - A	-	148	-	148	-
Liberty Global Plc - A	-	744	-	336	408
Liberty Global Plc - Series C	-	1,674	-	756	918
Liberty Global Plc Lilac - C	-	207	-	40	167
Liberty Interactive Corp Q - A	-	1,116	-	504	612
Liberty Ventures - Ser A	-	967	-	848	119
Linear Technology Corp	-	620	-	620	-
Marriott International - CI A	-	988	-	448	540
Mattel Inc	-	868	-	392	476
Maxim Integrated Products	-	744	-	336	408
Microchip Technology Inc	-	542	-	252	290
Micron Technology Inc	-	2,604	-	1,176	1,428
Microsoft Corp	-	19,840	-	9,090	10,750
Mondelez International Inc - A	-	3,906	-	1,764	2,142
Monster Beverage Corp	-	496	992	672	816
Mylan NV	-	1,302	-	588	714
Netapp Inc	-	744	-	744	-
網易公司-ADR	-	186	-	84	102
Netflix Inc	-	1,087	-	496	591
Norwegian Cruise Line Holdin	-	558	-	252	306
Nvidia Corp	-	1,364	-	616	748

# iShares安碩納斯達克100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 投資組合變動報表(未經審核)(續)

截至二零一六年十二月三十一日止年度

投資(續)	持股量				
	二零一五年 十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一六年 十二月 三十一日
<b>上市股本(續)</b>					
NXP Semiconductors NV	-	868	-	392	476
O'Reilly Automotive Inc	-	248	-	112	136
Paccar Inc	-	868	-	392	476
Paychex Inc	-	930	-	420	510
Paypal Holdings Inc	-	3,038	-	1,372	1,666
Priceline Group Inc/The	-	124	-	56	68
Qualcomm Inc	-	3,720	-	1,680	2,040
Regeneron Pharmaceuticals	-	262	-	112	150
Ross Stores Inc	-	992	-	448	544
SBA Communications Corp - Cl A	-	310	-	140	170
Seagate Technology	-	744	-	336	408
Shire Plc - ADR	-	224	-	104	120
Sirius XM Holdings Inc	-	12,524	-	5,656	6,868
Skyworks Solutions Inc	-	496	-	224	272
Starbucks Corp	-	3,720	-	1,680	2,040
Stericycle Inc	-	186	-	186	-
Symantec Corp	-	1,550	-	700	850
Tesla Motors Inc	-	372	-	168	204
Texas Instruments Inc	-	2,542	-	1,148	1,394
T-Mobile US Inc	-	2,046	-	924	1,122
Tractor Supply Company	-	310	-	140	170
Tripadvisor Inc	-	310	-	140	170
Twenty-First Century Fox - A	-	2,790	-	1,260	1,530
Twenty-First Century Fox - B	-	2,046	-	924	1,122
Ulta Salon Cosmetics & Fragr	-	186	-	104	82
Verisk Analytics Inc	-	434	-	196	238
Vertex Pharmaceuticals Inc	-	620	-	280	340
Viacom Inc - B類	-	868	-	392	476
Vodafone Group Plc - SP ADR	-	992	-	448	544
Walgreens Boots Alliance Inc	-	2,728	-	1,232	1,496
Western Digital Corp	-	682	-	308	374
Whole Foods Market Inc	-	806	-	806	-
Xilinx Inc	-	620	-	280	340
Yahoo! Inc	-	2,418	-	1,092	1,326

# iShares安碩納斯達克100指數ETF

(iShares安碩亞洲信託基金的成分基金)

## 表現紀錄(未經審核)

### 資產淨值

	每單位交易 資產淨值 美元	成分基金交易 資產淨值 美元
截至下列日期財務期間結束時 二零一六年十二月三十一日	1.15	7,845,929

### 最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值 美元	最低每單位 資產淨值 美元
截至下列日期止財務期間 二零一六年十二月三十一日(自成立以來)	1.18	0.99

# iShares 安碩亞洲信託基金

## 管理及行政

### 管理人董事

Andrew Reynolds(於二零一七年一月二十五日獲委任)  
Belinda Boa(於二零一六年四月二十九日獲委任)  
Graham Douglas Turl  
Michael Timothy Marquardt(於二零一七年一月二十五日辭任)  
Ryan David Stork  
金容湘(於二零一六年四月二十九日獲委任)  
陳蕙蘭

### 信託人

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

### 託管人(不包括 MSCI 中國 A 股 ETF、A50 中國 ETF 及滬深 300 A 股 ETF)

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

### QFII 保管人

花旗銀行(中國)有限公司  
中國上海  
陸家嘴金融貿易區  
花園石橋路33號  
花旗集團大廈  
郵編200120

### RQFII 保管人

滙豐銀行(中國)有限公司  
中國上海  
浦東區世紀大道8號  
上海國際金融中心滙豐銀行大廈33樓  
郵編200120

### MSCI 中國 ETF 過戶處

香港證券登記有限公司  
香港  
灣仔皇后大道東183號  
合和中心17樓

### MSCI 中國 ETF 兌換代理人

香港證券兌換代理服務有限公司  
香港  
中環  
港景街1號  
國際金融中心第一期  
12樓

### 核數師

羅兵咸永道會計師事務所  
香港  
中環  
太子大廈  
22樓

### 管理人

貝萊德資產管理北亞有限公司  
香港  
中環  
花園道3號  
冠君大廈16樓

### 所有成分基金(不包括 MSCI 中國 ETF)過戶處

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

### 託管人(僅就 A50 中國 ETF、MSCI 中國 A 股 ETF 及滬深 300 A 股 ETF 而言)

香港上海滙豐銀行有限公司  
香港  
中環皇后大道中1號

### QFII 牌照持有人(A50 中國 ETF)

貝萊德資產管理北亞有限公司  
香港  
中環  
花園道3號  
冠君大廈16樓

### RQFII 牌照持有人(MSCI 中國 A 股 ETF)

BlackRock Advisors (UK) Limited  
12 Throgmorton Avenue  
London EC2N 2DL United Kingdom

### RQFII 牌照持有人(A50 中國 ETF)

貝萊德資產管理北亞有限公司  
香港  
中環  
花園道3號  
冠君大廈16樓

### RQFII 牌照持有人(A50 中國 ETF 及滬深 300 A 股 ETF)

BlackRock (Singapore) Limited  
#18-01, Twenty Anson  
20 Anson Road,  
Singapore 079912

### 所有成分基金(不包括 MSCI 中國 ETF)

服務代理人  
香港證券兌換代理服務有限公司  
香港  
中環  
港景街1號  
國際金融中心第一期  
12樓

此乃白頁 特意留空

## 關於我們

貝萊德為向全球機構、中介及私人客戶提供資產管理、風險管理及顧問服務的卓越供應商。截至二零一六年十二月三十一日，貝萊德管理資產41,180億英鎊，資產類別涵蓋獨立賬戶、互惠基金、其他集成投資工具及業界領先的iShares®安碩交易所買賣基金。

透過BlackRock Solutions®，貝萊德結合資本市場專業知識與自主開發的分析法、系統及技術，提供風險管理及顧問服務。透過BlackRock Solutions®，貝萊德為逾200名客戶提供風險管理及企業投資服務。

貝萊德的客戶遍布北美及南美、歐洲、亞洲、澳洲、非洲及中東。以紐約為總部，貝萊德於全球30個以上國家設有辦事處。

## 欲了解更多詳情？

 [blackrock.com.hk](http://blackrock.com.hk)  [clientservice.asiapac@blackrock.com](mailto:clientservice.asiapac@blackrock.com)  +852 3903 2800

**BLACKROCK®**