

重要提示：

此乃重要文件，務須閣下即時垂注。如有疑問，請尋求專業意見。

香港聯合交易所有限公司(「**聯交所**」)、香港中央結算有限公司及香港證券及期貨事務監察委員會(「**證監會**」)對本公告之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並表明不會就本公告全部或任何部分內容而產生或因倚賴該等內容而引致之任何損失承擔任何責任。

管理人對本公告所載之資料之準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後確認，就其所知所信，並無遺漏任何其他事實，以致本公告任何聲明產生誤導，而本公告所表達之意見乃經過謹慎周詳考慮後始予達成。

投資涉及風險，包括損失投資本金。投資者考慮是否適合投資信託基金時，敬請考慮本身之投資目標及情況。信託基金未必適合所有人投資。

證監會認可不等於對該計劃作出推介或認許，亦不是對該計劃之商業利弊或表現作出保證，更不代表該計劃適合所有投資者，或認許該計劃適合任何個別投資者或任何類別之投資者。

iShares 安碩亞洲信託基金

香港證券及期貨條例(第 571 章)
第 104 條下認可之香港單位信託基金

iShares 安碩核心滬深 300 指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：02846)(人民幣櫃檯股份代號：82846)
(美元櫃檯股份代號：09846)

iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF (港元櫃檯股份代號：2823)
(人民幣櫃檯股份代號：82823)

iShares 安碩核心 MSCI 中國指數 ETF (股份代號：2801)

iShares 安碩核心標普 BSE SENSEX 印度指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：02836)(人民幣櫃檯股份代號：82836)
(美元櫃檯股份代號：09836)

iShares 安碩核心 MSCI 亞洲(日本除外)指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：03010)(人民幣櫃檯股份代號：83010)
(美元櫃檯股份代號：09010)

iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF (股份代號：2802)

iShares 安碩核心韓國綜合股價 200 指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：03170)(人民幣櫃檯股份代號：83170)
(美元櫃檯股份代號：09170)

iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：03074)(人民幣櫃檯股份代號：83074)
(美元櫃檯股份代號：09074)

iShares 安碩德國 DAX 指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：03146)(人民幣櫃檯股份代號：83146)
(美元櫃檯股份代號：09146)

iShares 安碩歐元區 STOXX 50 指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：03155)(人民幣櫃檯股份代號：83155)
(美元櫃檯股份代號：09155)

iShares 安碩富時 100 指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：02847)(人民幣櫃檯股份代號：82847)
(美元櫃檯股份代號：09847)

iShares 安碩納斯達克 100 指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：02834)(人民幣櫃檯股份代號：82834)
(美元櫃檯股份代號：09834)

iShares 安碩核心恒生指數 ETF
(港元櫃檯股份代號：03115)(人民幣櫃檯股份代號：83115)
(美元櫃檯股份代號：09115)

**iShares 安碩亞洲信託基金(「信託基金」)
之子基金(「子基金」)**

公告

**為遵守經修訂的《單位信託及互惠基金守則》
而作出的變動**

**增加取得參與 MSCI 亞洲新興市場指數
印度成分股投資機會的例子
(僅適用於 iShares 安碩 MSCI 亞洲新興市場指數 ETF)**

**基礎指數的變動
(僅適用於 iShares 安碩核心 MSCI 台灣指數 ETF)**

澄清有關分派收益的變動

貝萊德資產管理北亞有限公司(「**管理人**」)為信託基金及子基金之管理人，謹此公佈，由二零一九年十一月二十七日起(「**生效日期**」)，對子基金作出以下修訂：

- 信託契據將予修訂和重述，章程將予更新，以遵守經修訂的《單位信託及互惠基金守則》(「**守則**」)。
- 就iShares安碩MSCI亞洲新興市場指數ETF(「**MSCI亞洲新興市場ETF**」)，增加取得參與基礎指數印度市場部分投資機會的例子。除了iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF外，管理人亦可以投資其他ETF(包括證監會認可ETF和未認可ETF)和金融衍生工具(例如期貨和指數期貨)，以追蹤基礎指數的印度上市成分股的表現。
- 就iShares安碩核心MSCI台灣指數ETF(「**MSCI台灣ETF**」)，基礎指數將由MSCI台灣指數更改為MSCI台灣20/35指數，以確保MSCI台灣ETF將持續追蹤符合經修訂守則監管期望的指數，即該指數的成分證券應廣泛分布。於生效日期前後之3至5個交易日，MSCI台灣ETF所持有的資產將會重新調整。

澄清有關分派收益的變動亦將載於子基金章程內。

除本公告另有定義外，本公告所用的界定詞彙與各子基金章程所界定者具相同涵義。

1. 為遵守經修訂的《單位信託及互惠基金守則》而作出的變動

信託基金日期為二零零一年十一月十六日經不時修訂的信託契據(「**信託契據**」)將通過第二十五份於二零一九年十一月二十七日(「**生效日期**」)生效之補充契據修訂。各子基金的章程及產品資料概要(「**產品資料概要**」)，連同章程統稱為「**章程**」亦於生效日期修訂。

修訂及重述信託契據和更新章程旨在納入相關變動，以遵守經修訂守則的規定。經修訂的守則於二零一九年一月一日生效，現有計劃(即證監會先前認可的基金)可有12個月過渡期。

信託契據的變動涉及以下內容：

1. 適用於各子基金的投資限制已經修訂，以反映經修訂守則第7章及第8.6節(非上市指數基金及跟蹤指數交易所買賣基金)的最新投資限制。投資者可參閱各章程附表一中於生效日期起適用的經修訂投資限制；
2. 經修訂守則第8.2節(貨幣市場基金)、第8.8節(結構性基金)和第8.9節(廣泛投資於金融衍生工具的基金)的投資限制亦載於信託契據中以用於信託基金未來推出的子基金(如適用)。各子基金不屬於經修訂守則該等章節的規定範圍，因而該等章節不適用於各子基金；
3. 根據經修訂守則分別增加信託人及管理人的責任；及
4. 為遵守經修訂守則所作出的其他變動。

章程亦將予更新，以反映上述變動(如適用)。

此外，各子基金的產品資料概要將於生效日期根據證監會就ETF發出的最新產品資料概要範本作出更新。尤其是，各產品資料概要中就相關子基金運用衍生工具／投資衍生工具的資料會以獨立章節作出披露。為免生疑問，各子基金運用衍生工具的政策並無變動。

各子基金的投資目標、基礎指數（下文第3節所述的基礎指數除外）及投資策略維持不變，並不會因為遵守經修訂守則而被影響。各子基金的風險狀況概無重大變動。

根據信託契據及適用法律及法規，信託契據的變動無須得到基金單位持有人批准。信託人同意信託契據的變動。

2. 增加取得參與MSCI亞洲新興市場指數印度成分股投資機會的例子（僅適用於MSCI亞洲新興市場ETF）

目前，MSCI亞洲新興市場ETF投資於iShares安碩核心標普BSE SENSEX印度指數ETF（在香港上市），以取得參與作為基礎指數之MSCI亞洲新興市場指數印度證券（「**印度成分股**」）的投資機會。由生效日期開始，管理人計劃擴大MSCI亞洲新興市場ETF的投資例子清單，以取得參與印度成分股的投資機會，因此，管理人將可酌情投資於以下任何一項或全部：

1. 其他交易所買賣基金(ETF)，包括證監會認可ETF和非證監會認可ETF（「**基礎印度ETF**」）；及
2. 金融衍生工具，如在新加坡交易所有限公司(SGX)、歐洲期貨交易所(EUREX)、洲際交易所(ICE)和香港聯合交易所有限公司(HKEX)等證券交易所上市的期貨和指數期貨，

（統稱為「**印度投資**」）。

印度投資的表現並無保證，亦不保證其分別的未來表現與印度成分股相關。管理人尋求於相關時間按印度成分股比重（佔MSCI亞洲新興市場指數市值之百分比），將MSCI亞洲新興市場ETF以相應的合併比重（佔MSCI亞洲新興市場ETF資產淨值之百分比）投資於印度投資。為免生疑問，MSCI亞洲新興市場ETF就運用衍生工具方面的政策沒有改變。

倘MSCI亞洲新興市場ETF投資於任何由管理人或其任何聯屬公司管理的ETF（「**貝萊德ETF**」），包括任何上述的基礎印度ETF，所有就該貝萊德ETF的首次收費會被豁免，且管理人會致力確保MSCI亞洲新興市場ETF及其基金單位持有人不會因為MSCI亞洲新興市場ETF投資於該貝萊德ETF，而導致應付管理人及／或其聯屬公司之首次收費、管理費或任何其他成本及徵費之整體總額有所增加。

投資者應參考MSCI亞洲新興市場ETF經修訂章程的「ETF投資風險」風險因素，了解有關進一步詳情。

理據及影響

管理人已決定擴大印度投資的範圍，旨在提高MSCI亞洲新興市場ETF的追蹤表現。然而，投資者注意，基金表現並無保證，儘管管理人的努力，但MSCI亞洲新興市場ETF的表現可能會因為收費和費用、指數成分股流動性以及MSCI亞洲新興市場指數的變更等因素而偏離MSCI亞洲新興市場指數的表現。

除上述披露者外，擴大印度投資的範圍預計不會對MSCI亞洲新興市場ETF的風險狀況產生重大影響。

3. 基礎指數的變動(僅適用於MSCI台灣ETF)

由生效日期起，MSCI台灣ETF的基礎指數將由MSCI台灣指數(「現有指數」)更改為MSCI台灣20/35指數(「上限指數」)(「指數變動」)。指數變動將於生效日期生效。管理人建議進行指數變動，以確保子基金將持續追蹤符合經修訂守則監管期望的指數，即該指數的成分證券應廣泛分布。於生效日期前後之3至5個交易日，MSCI台灣ETF所持有的資產將會重新調整，按相應比重納入上限指數的成分股。有關重新調整過程的進一步詳情，請參閱下文C節。

A. 有關上限指數的資料及現有指數與上限指數之間的比較

上限指數乃由摩根士丹利資本國際公司(MSCI Inc.)(「指數提供者」)計算、公佈及維持之指數，與現有指數的指數提供者相同。

下表列出現有指數與上限指數主要特點的比較：

	MSCI台灣指數(現有指數)	MSCI台灣20/35指數(上限指數)
指數提供者	MSCI Inc.	MSCI Inc.
指數目標	現有指數計量台灣市場大中型市值股的表現。	上限指數旨在計量台灣市場大中型市值股的表現。
指數類型	淨總回報指數	淨總回報指數
上限規則	沒有	<p>有</p> <p>上限指數根據其指數編制方法須符合以下規則(「上限規則」)：</p> <p>規則1：最大成分證券的比重不能超過35% (按自由流通量調整市值計算)，並且在每次重新調整指數時上限採用10%的緩衝。如果在一天結束時，最大成分證券的比重超過35%，則上限為31.5%，任何超出的比重均按比例分配給其他成分證券。</p> <p>規則2：餘下成分證券的比重均不能超過20% (按自由流通量調整市值計算)，並且在每次重新調整指數時上限採用10%的緩衝。如果在一天結束時，任何餘下成分證券的比重超過20%，則上限為18%，任何超出的比重均按比例分配給其他成分證券。</p>

		儘管同日短暫飆升可能會違反預定的上限值，但實施規則 1 和 2，確保上限指數在下一個交易日開市之前符合比重限制。
按自由流通量調整市值的指數	5,910 億美元	5,910 億美元
5 大指數成分股	台灣積體電路製造股份有限公司 (34.36%) 鴻海精密工業股份有限公司 (4.99%) 聯發科技股份有限公司 (2.98%) 台灣塑膠工業股份有限公司 (2.26%) 中華電信股份有限公司 (2.23%)	台灣積體電路製造股份有限公司 (31.75%) 鴻海精密工業股份有限公司 (5.18%) 聯發科技股份有限公司 (3.10%) 台灣塑膠工業股份有限公司 (2.35%) 中華電信股份有限公司 (2.32%)
成分股數目	87	87
重新調整次數	按季度 – 2 月、5 月、8 月和 11 月	按季度 – 2 月、5 月、8 月和 11 月
路透社代號	.MITW00000NUS	.MITW00003NUS
彭博代號	NDEUSTW	NU727318

截至 2019 年 8 月 30 日的數據

除上限規則外，上限指標的指數目標和所有其他指數構建的標準(包括指數範圍，指數成分股的加權方法和重新調整方法)均與現有指數相同。

投資者可以從指數提供者的網站(www.msci.com)獲取最新的上限指數成分股清單，其各自的權重及有關上限指數的其他資料(包括指數概覽、編制方法、每日收市指數水平和指數表現)。

投資者應注意，(i) 兩個指數的未來表現相互關係及(ii) 指數變動後 MSCI 台灣 ETF 的回報均並無保證。

管理人認為，指數變動不會對現有投資者的權利或利益造成重大損害，指數變動後，除了 MSCI 台灣 ETF 涉及重新調整期間的風險和過往表現的風險外，不會增加整體風險狀況。

B. 對 MSCI 台灣 ETF 的影響

除上文所述外，本公告所述的指數變動預期不會影響 MSCI 台灣 ETF 的現行操作及/或管理方式。指數變動後，

- MSCI 台灣 ETF 的中英文名稱和股票簡稱將維持不變；
- MSCI 台灣 ETF 的管理費將維持不變，以及 MSCI 台灣 ETF 的管理費用水平/成本不會發生任何變化；

- 有關 MSCI 台灣 ETF 過去表現的資料將繼續載於 MSCI 台灣 ETF 的產品資料概要內。然而，投資者應注意，由於本公告所述的指數變動，在生效日期之前達至表現的情況將不再適用。

管理人預期 MSCI 台灣 ETF 的經常性開支比率和追蹤偏離度不會有重大變動。產品資料概要目前披露截至二零一八年十二月三十一日止年度的數字。管理人將監察經常性開支比率和追蹤偏離度，並在必要時根據證監會的有關指引更新產品資料概要內的數字。有關追蹤偏離度的資料將繼續在管理人的網站 www.blackrock.com/hk 刊發(該網站未經證監會審閱)。

本公告所述的指數變動不須基金單位持有人批准。

有關指數變動的相關成本將由管理人承擔。

C. 重新調整過程

MSCI 台灣 ETF 就現有指數成份股和比重所持有的資產，將重新調整至上限指數的成份股和比重，該調整將於生效日期前後 3 至 5 個交易日進行(「**重新調整**」)。於重新調整期內，MSCI 台灣 ETF 的追蹤誤差及追蹤偏離度可能高於其歷史水平。投資者應注意，於重新調整後，並不保證 MSCI 台灣 ETF 的追蹤誤差及追蹤偏離度將與指數變動前相若。

管理人預計重新調整不會對市場產生任何重大影響。

有關於重新調整所涉及的風險，請參閱附錄 1。

D. 風險因素

如上所述，重新調整可能涉及風險。一般而言，指數變動亦涉及風險。有關潛在風險因素，請參閱本公告附錄 1。

4. 於章程作出的其他更改

各子基金的章程將予更新，以澄清在終止子基金時，終止所得款項可以相關子基金基礎貨幣以外的貨幣分派及支付。

5. 一般事項

經修訂章程將於生效日期上載至管理人網站 www.blackrock.com/hk (該網站未經證監會審閱) 及香港交易及結算所有限公司網站 www.hkex.com.hk。由生效日期起，經修訂的信託契據副本亦將可於任何一天(不包括週六、週日和公眾假期)的日常辦公時間在管理人辦公室(地址如下)供免費索閱。

閣下如對本公告有任何問題，請致電 +852 3903 2823 與我們聯絡或親臨香港中環花園道三號冠君大廈十六樓。

貝萊德資產管理北亞有限公司

BlackRock Asset Management North Asia Limited

作為信託基金及子基金之管理人

香港

二零一九年十月二十五日

附錄 1

風險因素

A. 有關重新調整的風險

於重新調整期，MSCI 台灣 ETF 就現有指數成份股和比重所持有的資產，將重新調整至上限指數的成份股和比重。儘管現有指數與上限指數之間存在高度相關性，但管理人認為，MSCI 台灣 ETF 在重新調整期間的追蹤誤差及追蹤偏離度可能會增加。於生效日期前，投資者在買賣 MSCI 台灣 ETF 的基金單位時，應謹慎行事。

B. 過去表現的風險

由於指數變動，在生效日期之前達至 MSCI 台灣 ETF 過往表現的情況，在生效日期起將不再適用。於生效日期前，投資者在考慮 MSCI 台灣 ETF 的過去表現時，應謹慎行事。