

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

基金經理對本公佈所載的資料於刊發日期的準確性負全責，並確認經一切合理查詢後，就其所知所信，於本公佈刊發日期時，確認本公佈內表達的一切意見乃經審慎周詳的考慮後作出。

閣下如對本公佈的內容有任何疑問，閣下應向閣下的股票經紀、銀行經理、律師、會計師或其他專業顧問查詢。

## 標智滬深 300 中國指數基金<sup>®\*</sup>

(\*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

## W.I.S.E. – CSI 300 China Tracker<sup>®\*</sup>

(\* This is a synthetic ETF)

## 其為標智 ETFs 系列的一個子基金

(根據《證券及期貨條例》(香港特別行政區法例第 571 章)

第 104 條獲認可之香港單位信託)

(股份代號：02827)

### 公佈額外的認可條件

標智滬深 300 中國指數基金<sup>®\*</sup> (\*此基金為一隻合成交易所買賣基金) (「**本基金**」) 的基金經理特此公佈，根據證券及期貨條例第 104(4)條，除了本基金現有認可條件以外及在不影響現有條件情況下，證監會對本基金之認可加上額外的認可條件。

中銀國際英國保誠資產管理有限公司（「**基金經理**」）特此向投資者公告，證監會已通知基金經理其現已對本基金實施若干新認可條件。新認可條件的概覽如下：

- (i) 在切實可行的情況下盡快，但無論如何不遲於 2011 年 10 月 31 日實行：
  - (a) 本基金所持有的抵押品須最少為本基金承受的總交易對手風險的 100%，並須保持在該百分比，每日以市價計算，目的是確保交易對手風險已獲抵押品支持；
  - (b) 若取得的抵押品的性質是股票證券，該抵押品須符合額外的要求，即該股票抵押品的市值最少為有關總交易對手風險的 120%。
- (ii) 在不影響任何規則及規例的一般性原則的情況下：
  - (a) 抵押品須符合《單位信託及互惠基金守則》第 8.8(e) 項的要求，及證監會於不時作出的其他補充性的指引；

- (b) 基金經理作為受信人，以應有的謹慎態度和技巧，並考慮所有有關因素，包括但不限於持有的抵押品的信貸質素、流通性、期限及其他有關條款，須對本基金持有的任何非股票抵押品採用審慎扣減的政策。
- (iii) 在不受限於以上第(i)段所列出的條件下，基金經理作為受信人，在考慮單位持有人利益的前提下，及不時因應市場的環境下，須以應有的謹慎態度和技巧動態地管理抵押品。基金經理將會在風險管理方面保持警覺性，倘若在市場環境有需要下，基金經理將會以其專業判斷決定是否須提前於 2011 年 10 月 31 日以前完全實施以上第(i)段所提及的條件。
- (iv) 本基金不時經修改的抵押品管理政策，將在切實可行的情況下盡快，但無論如何不遲於 2011 年 9 月 12 日刊登於本基金的網址內，而該政策必須符合以上第(i)段及(ii)段所列出的條件。

基金經理將在收到證監會的通知後，修改抵押品政策，並向交易對手要求額外的抵押品，以確保符合新認可條件，並於切實可行的情況下盡快於 2011 年 10 月 31 日或之前實施新抵押品政策。新抵押品政策將包括以下要項：

- (i) 抵押品的可接受性是根據《單位信託及互惠基金守則》第 8.8(e)段內的要求而規定。
- (ii) 抵押品將每日以市價估值。
- (iii) 基金經理會視乎抵押品的性質及其發行人的信貸評級，對抵押品作審慎扣減。

新抵押品措施將會於切實可行的情況下，盡快於 2011 年 10 月 31 日或之前生效，並會於 2011 年 9 月 12 日或之前刊登於基金經理網址 ([www.boci-pru.com.hk](http://www.boci-pru.com.hk))。

由於更新抵押品措施，基金經理預計本基金須支付的收費、費用及開支將會增加。本基金的投資表現可能因此而受到不利的影響，因而引致追蹤誤差增加。截至本公佈為止，為符合新認可條件而須額外獲取的抵押品有關的費用估計大約為本基金資產淨值的 0.4%。投資者須注意，實際額外費用須視乎實際所獲取的抵押品，有關費用可能高於或低於估計的數目。

本基金的基金認購章程也將要更新，將包括更新後的抵押品政策的概要及其他有關披露。本基金已更新之基金認購章程會於新抵押品生效前，即於 2011 年 10 月 31 日或之前在香港交易及結算所有限公司網址 ([www.hkex.com.hk](http://www.hkex.com.hk)) 及基金經理的網址 ([www.boci-pru.com.hk](http://www.boci-pru.com.hk)) 可供查閱。

本公佈未有定義的詞語應具有基金認購章程所給予的意義。

投資者如對上述事項有任何查詢，可致電 (852) 2280 8697 與我們的客戶服務部聯絡。

二零一一年八月二十九日