

重要：香港聯合交易所有限公司、證券及期貨事務監察委員會以及香港中央結算有限公司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，並明確表示，概不對因本公告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。

基金經理對本公告所載的資料之準確性負全責，並確認，經作出一切合理查詢後，就其所知所信，本公告所表達之一切意見乃經過謹慎周詳考慮後始予達成。

如閣下對本公告的內容有任何疑問，應諮詢閣下的股票經紀、銀行經理、律師、會計師或其他專業顧問。



普盛 CSI RAFI 50 ETF*

(*此基金為一隻合成交易所買賣基金)

股份代號: 2818

有關證券及期貨事務監察委員會施加附加認可條件的公告

中國平安資產管理（香港）有限公司（「基金經理」）特此告知投資者，證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）已於 2011 年 8 月 29 日通知基金經理，應對普盛 CSI RAFI 50 ETF*（*此基金為一隻合成交易所買賣基金）（「子基金」）施加某些新的認可條件。新的認可條件如下：

- (i) 按實際情況盡早地，但無論如何不遲於 2011 年 10 月 31 日：
 - (a) 子基金持有的抵押品必須至少相當於子基金所承擔的全部交易對手方總風險的 100%，並必須加以維持，每日按市值計值，旨在確保不存在在無抵押情況下承擔的交易對手方風險；
 - (b) 如持有的抵押品屬於股票證券性質，則該抵押品應符合一項附加要求，即該股票抵押品的市場價值至少相當於相關的所承擔交易對手方總風險的 120%；
- (ii) 在不影響任何規則和條例之普遍性的條件下：
 - (a) 抵押品必須滿足經證監會不時以其他指引加以補充的《單位信託及互惠基金守則》第 8.8(e)條的要求；
 - (b) 基金經理，作為受信託人身份並以應有謹慎的關注和技巧的條件下，應在考慮到所有相關因素（包括但不限於所持抵押品的信貸質素、流通性、期限及其他相關條款）的情況下，對子基金所持的任何非股票抵押品採用謹慎的扣減政策；
- (iii) 雖有上文(i)段規定的條件，基金經理作為受信託人身份，應以應有謹慎的關注和技巧，

本着單位持有人的利益，在適當考慮不時的市場情況的條件下，對抵押品進行動態管理。基金經理在其風險管理當中應保持警覺，且若在市場情況需要下，基金經理應行使其專業判斷，決定是否應提前到 2011 年 10 月 31 日前的一個日期充分實施上文(i)段規定的條件；及

- (iv) 子基金經不時修訂的抵押品管理政策須按實際情況盡早地，但在任何情況下不得遲於 2011 年 9 月 12 日，於子基金的網頁刊登，並受限於該政策必須符合上文 (i) 及 (ii) 段規定的條件。

在收到證監會的通知後，基金經理將修訂其抵押品政策並從交易對手方獲得補充抵押品，以便按實際情況盡早地於 2011 年 10 月 31 日當日或之前滿足新的認可條件和執行新的抵押品政策。新的抵押品政策將包括下列各項：

- (i) 基金經理可接受現金、國庫債券或股票證券（在香港或海外上市或交易的）作為子基金的抵押品。
- (ii) 抵押品是否可被接受將按照證監會《單位信託及互惠基金守則》第 8.8(e)條的要求確定。
- (iii) 抵押品將每日按市值估值。
- (iv) 子基金持有的抵押品將至少相當於其承擔的交易對手方總風險。
- (v) 基金經理將在考慮到如抵押品發行人的信貸質素等因素以及其他相關因素的情況下採用謹慎的扣減政策。

新的抵押品政策亦將按實際情況盡早地於 2011 年 10 月 31 日當日或之前生效，並將於 2011 年 9 月 12 日當日或之前在基金經理的網站 (<http://asset.pingan.com.hk>) 「產品介紹」一頁中公佈。

由於抵押品政策的修改，基金經理預計子基金應付的費用、收費和支出會有所增加。符合新的認可條件的額外抵押品要求的費用，目前估計在子基金資產淨值 0.7% 至 1% 的範圍內。投資者須注意，視乎真正獲得的抵押品，真正額外抵押品要求的費用可能會低於或高於以上的估計。子基金的業績因此可能受到不利影響，以致造成追蹤誤差增加。但是，基金經理認為，抵押品的增加程度將會減少子基金所承擔的交易對手方風險，因而加強對投資者的保護。

子基金的基金認購章程亦將予以更新，以載入經修改的抵押品政策的簡要說明及其他相關的披露。經更新的基金認購章程將於新的抵押品政策生效當日或之前，即按實際情況盡早地於 2011 年 10 月 31 日當日或之前，在基金經理的網站 (<http://asset.pingan.com.hk>) 「產品介紹」一頁中提供。

如閣下對本公告有任何查詢，可致電+852 3762 9228 與我們聯絡。

中國平安資產管理（香港）有限公司

2011 年 8 月 29 日

本公告未有定義的詞語應具有基金認購章程所給予的涵義。