

產品資料概要

BMO 納斯達克 100 ETF

BMO Global Asset Management (Asia) Limited

2018年4月20日

本基金是交易所買賣基金。
本概要提供本基金的重要資料。
本概要是基金章程的一部分。
閣下不應單憑本概要作投資決定。

資料便覽

| | |
|-------------|---|
| 股票代號： | 3086 |
| 每手買賣單位數目： | 200個基金單位 |
| 經理人： | BMO Global Asset Management (Asia) Limited |
| 信託人： | Cititrust Limited |
| 過戶登記處： | 卓佳證券登記有限公司 |
| 全年經常性開支： | 0.30% [#] |
| 上一日曆年跟蹤偏離度： | -0.40% ^{##} |
| 相關指數： | 納斯達克-100指數 |
| 基準貨幣： | 港元 |
| 交易貨幣： | 港元 |
| 財政年度終結日： | 12月31日 |
| 派息政策： | 經理人擬最少每半年(通常是每年三月及九月)一次向單位持有人分派收入。概不保證會定期作出分派，亦不保證分派額。現時並無意從資本或實際從資本作出分派。 |
| ETF網址： | www.bmo.hk/etfs |

本基金是甚麼產品？

本基金是根據香港法律成立並以單位信託形式組成的基金，是BMO ETF的子基金。BMO 納斯達克100 ETF(「子基金」)的基金單位在香港聯合交易所有限公司(「聯交所」)上市，這些基金單位如上市股票一般在聯交所買賣。子基金是根據《單位信託及互惠基金守則》第8.6條及附錄I規定的被動式管理的跟蹤指數交易所買賣基金。

[#] 全年經常性開支數字基於截至2017年12月31日的年度費用。數字可能每年都有變動。經常性開支數字代表向子基金收取的持續費用總額，以子基金平均資產淨值的百分率表示。

^{##} 這是截至2017年12月31日的實際年度跟蹤偏離度。有關實際的跟蹤偏離度資料，投資者應參閱子基金的網址。

目標及投資策略

目標

子基金的目標是提供在扣除費用及開支之前盡量貼近納斯達克-100 指數(「**相關指數**」)表現的投資業績。

策略

經理人擬主要採用完全複製策略以達到子基金的投資目標。然而，經理人可在適當情況下選擇採用代表性抽樣策略。

子基金採用模擬策略時，將按相關指數成分證券在相關指數所佔實質相同的比重(即按比例)投資於實質上全部相關指數成分證券。

子基金採用代表性抽樣策略時，將直接或間接投資於相關指數所包含的證券或投資於並非相關指數成分證券但經理人認為有助子基金達到其投資目標的證券。

投資者應注意，經理人可全權酌情決定轉換使用完全複製及代表性抽樣策略，並無須通知投資者。

子基金現時無意：

- (a) 投資於任何金融衍生工具作對沖或非對沖(即投資)用途；或
- (b) 參與證券借出、回購交易或其他類似的場外交易

但這或會根據市場情況而改變，若子基金參與此類交易，應事先取得證監會批准，而且須向單位持有人發出不少於一個月的事先通知。

子基金的投資策略須遵守基金章程訂明的投資及借貸限制。

相關指數

相關指數是修正的市值加權指數，由指數提供者 **The NASDAQ OMX Group, Inc.** 編製及公佈。相關指數包含在納斯達克股票市場上市的按市值計一百間最大的國內及國際非金融公司。相關指數反映各大行業界別的公司，包括電腦硬件和軟件、電訊、零售/批發貿易及生物科技，並不包含金融公司(包括投資公司)的證券。相關指數成分證券的比重按其市值計算，須遵守有關規則，以便為最大成分證券的影響設定上限。

如要符合首批被納入相關指數的資格，證券必須符合下列條件：

- (1) 證券發行人在美國的第一上市市場必須是納斯達克環球精選市場或納斯達克環球市場，而且是獨家上市(除非證券於2004年1月1日前在另一美國市場雙重上市並且一直維持該上市地位)；
- (2) 證券必須由非金融公司發行。非金融公司是根據行業分類基準(ICB)歸類於8000以外所有行業編碼之下的公司；
- (3) 證券不可由現時正進行破產程序的發行人發行；
- (4) 證券在之前三個月交易期內平均每日交投量必須至少有200,000股；
- (5) 證券發行人不可訂立任何確定協議或其他安排以致可能導致證券不再符合相關指數的納入資

格；及

- (6) 證券必須已在納斯達克、紐約證交所或美國證交所上市至少滿三個月，不包括首次上市的第一個月。

如要繼續符合納入相關指數的資格，相關指數證券必須符合上述條件，而且於每月底在相關指數的比重必須相等於或超過 0.1%。如公司連續兩個月於月底未能符合此條件，將從相關指數移除，並於下一個月第三個星期五收市後生效。

相關指數於 1985 年 1 月 31 日推出，基礎水平為 125。

相關指數是總回報淨額指數。總回報淨額指數依據任何股息或分派額在扣除可能適用的稅項之後再投資而計算指數成分股的表現。

至 2018 年 3 月 31 日為止，相關指數的總市值為 7.5 萬億美元，含有 103 隻成分股。發行人可以有許多於一類符合納入相關指數資格的證券，將列為獨立的成分股。

相關指數以港元計值。

經理人(及其每名關連人士)均獨立於指數提供者 The NASDAQ OMX Group, Inc.。

至 2018 年 3 月 31 日為止，相關指數的十大成分股(合共佔相關指數的 54.05%)如下：

| 排名 | 成分股 | 比重(%) |
|----|-----------------------------|-------|
| 1 | 蘋果公司 (Apple Inc.) | 11.34 |
| 2 | 微軟 (Microsoft Corp.) | 9.36 |
| 3 | 亞馬遜公司 (Amazon.com Inc.) | 9.34 |
| 4 | Facebook Inc. | 5.10 |
| 5 | Alphabet - Class C | 4.81 |
| 6 | Alphabet - Class A | 4.13 |
| 7 | 英特爾 (Intel Corp.) | 3.24 |
| 8 | 思科系統公司 (Cisco Systems Inc.) | 2.75 |
| 9 | Comcast Corp. | 2.11 |
| 10 | NVIDIA Corp. | 1.87 |

相關指數成分股最新名單及有關相關指數包括指數方法及相關指數的收市水平等附加資料，可在 The NASDAQ OMX Group, Inc. 的網址 <https://indexes.nasdaqomx.com/Index/Weighting/NDX> 取得。

本基金有哪些主要風險？

投資涉及風險。請參閱基金章程，了解風險因素等資料。

集中及美國市場風險

- 子基金的投資集中於單一國家(即美國)及在單一證券交易所(即納斯達克)買賣的證券。與具有較多元投資組合的基金相比，子基金的價值可能較為波動。
- 子基金投資於日本股票市場的證券。日本經濟高度依賴國際貿易，可能受保護主義措施、新興經濟體的競爭、與其貿易夥伴的政治張力及其經濟狀況、自然災害及商品價格等因素的不利影響。

- 經濟衰退，美國進口縮減，美元匯率的變動及公共債務日增，都可能對美國的經濟發展及子基金所投資的美國證券帶來不利的影響。子基金投資於美國證券亦可能須繳付美國稅項。

交易時段不同的風險

- 由於納斯達克股票市場的開放時間正值子基金的基金單位沒有報價之時，子基金投資組合內證券的價值在投資者不能買賣基金單位的日子可能有變動。納斯達克股票市場與聯交所交易時段不同或會增加基金單位買賣價相對於資產淨值的溢價或折價程度。

管理風險

- 由於無法保證子基金的表現與相關指數相同，子基金須承受管理風險。這是指經理人的策略由於在實行上有若干限制而未必能產生擬定效果的風險。此外，經理人可全權酌情決定行使單位持有人就子基金成分證券的權利，惟概不能保證行使上述酌情權可達到子基金的投資目標。

跟蹤誤差風險

- 子基金可採用代表性抽樣策略。因此，子基金可能會出現更大的跟蹤誤差風險，即其表現未必能準確跟蹤相關指數的表現。其他因素例如費用及開支及未能因應相關指數的變化重新調整子基金持有的證券等亦可能導致跟蹤誤差。概不能保證子基金於任何時候均可確切地或完全相同地複製相關指數的表現。

投資風險

- 子基金是一隻投資基金。概不能保證一定能償還本金，因此閣下在子基金的投資或會蒙受損失。

外匯風險

- 投資於子基金或會直接或間接涉及匯率風險。相關指數的成分證券可能以不同於子基金基準貨幣(即港元)的貨幣計值。該貨幣與基準貨幣之間的匯率波動或會對子基金的表現造成不利的影響。

被動式投資風險

- 子基金並不會以主動方式管理，在逆市中亦不會採取臨時防禦措施。因此在相關指數下跌時，子基金亦會貶值。投資者或會因此蒙受重大損失。

交易風險

- 一般而言，散戶投資者只能在聯交所購買或出售基金單位。基金單位在聯交所的買賣價格視乎市場因素而定，可能以每基金單位資產淨值的大幅溢價或折價買賣。
- 投資者在聯交所購買或出售基金單位將支付若干收費(例如交易費用及經紀費)，在聯交所購入基金單位時，所支付的或會超出每基金單位的資產淨值，而在聯交所出售基金單位時，所收取的亦可能少於每基金單位的資產淨值。

對莊家依賴的風險

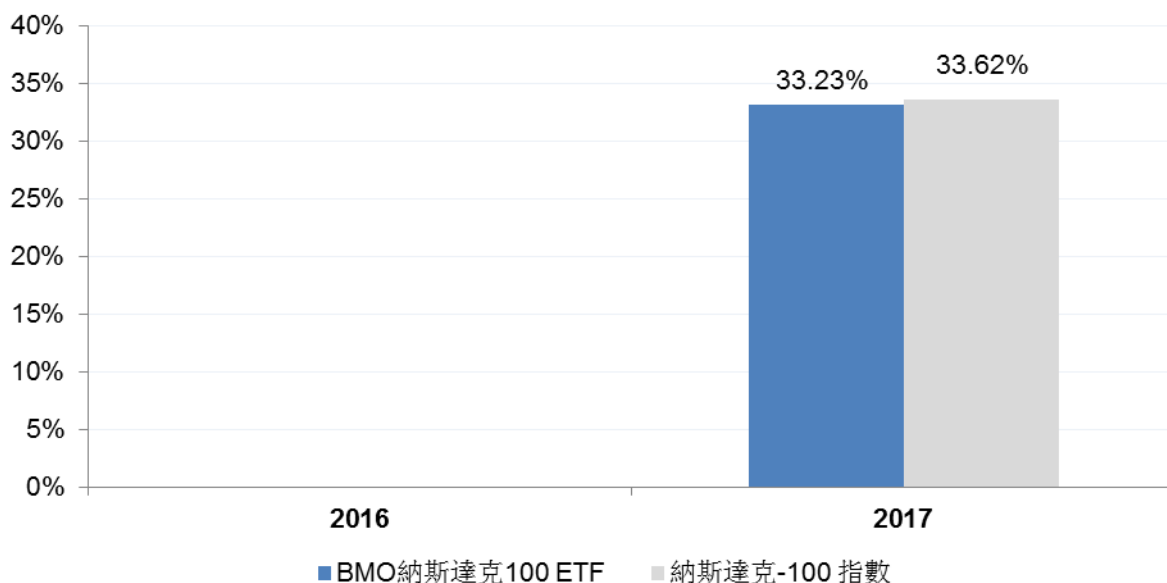
- 雖然經理人確保至少有一名莊家為子基金的基金單位維持市場，但應注意，若不為子基金的基金單位設立莊家，基金單位在市場的流動性可能受到不利影響。經理人將確保子基金

的基金單位的至少一名莊家在根據有關造市協議規定終止造市之前發出至少三個月的通知，以盡量減低此風險。子基金可能只有一名聯交所莊家或經理人未必能夠在莊家的終止通知期之內聘用接替的莊家，亦不保證任何造市活動均有效。

提前終止的風險

- 子基金在若干情況下或會提前終止，例如相關指數不再可供作為基準或子基金所有基金單位的資產淨值合計少於1億港元。有關進一步詳情，投資者應參閱基金章程「終止」一節。當子基金終止時，投資者可能蒙受損失。

本基金的表現如何？



- 過往業績並非未來表現的指標。投資者可能無法收回投資的全部數額。
- 基金表現根據日曆年終結時，基金單位資產淨值，股息再投資的基礎計算。
- 此數據顯示基金價值在該日曆年內的升跌幅度。基金表現數據以港元計算，包括持續性的費用，但不包括投資者在聯交所支付的費用。
- 如果某個日曆年沒有顯示過往的表現，表示該年度並沒有足夠的數據可提供表現資料。
- 相關指數：納斯達克-100 指數
- 本基金推出日期：2016年2月18日

本基金有否提供保證？

子基金並不提供任何保證。閣下未必能取回投資本金。

投資本基金涉及哪些費用及收費？

在聯交所買賣本基金的收費

費用

由閣下繳付

經紀費

市場收費率

| | |
|------|----------------------|
| 交易徵費 | 0.0027% ¹ |
| 交易費 | 0.005% ² |
| 印花稅 | 沒有 |

本基金持續繳付的費用

以下收費將從本基金中扣除，閣下會受到影響，因為子基金的資產淨值會因而減少，從而影響買賣價格。

| | <u>每年收費率(佔資產淨值百分比)</u> |
|---------|-------------------------|
| 管理費* | 每年0.30% |
| 信託人費 | 列入管理費內 |
| 過戶登記處費用 | 列入管理費內 |
| 表現費 | 沒有 |
| 行政管理費 | 列入管理費內 |
| 其他持續成本 | 有關子基金應繳付的持續成本詳情，請參閱基金章程 |

* 上文所述就子基金須支付予經理人的現行費用可在向單位持有人發出通知後增加，惟以允許的最高收費率為限。有關須支付的費用及收費及其允許最高收費率以及其他可能由子基金承擔的持續開支的進一步詳情，請參閱基金章程「費用及開支」一節。

其他費用

閣下買賣子基金的基金單位或須繳付其他費用。有關基金單位的增設或贖回或買賣所適用的其他費用及開支詳情，請參閱基金章程。閣下亦應向閣下的中介機構查明付款過程，包括閣下結算該等費用應使用的貨幣及在交易中若須進行貨幣兌換應如何釐定匯率。

其他資料

閣下可在下列網址閱覽以下有關子基金的資料 www.bmo.hk/etfs。

- (a) 基金章程及與子基金有關的本產品資料概要(不時修改)；
- (b) 最新的已審核年度賬目及未經審核的中期半年度報告(只提供英文版)；
- (c) 有關對基金章程或子基金的組成文件作出重大修改或增補的通知；
- (d) 子基金發出的任何公告，包括與子基金及相關指數有關的資料、暫停計算資產淨值、更改費用及暫停和恢復買賣的通知；
- (e) 接近實時的每基金單位估算資產淨值(以港元表示)，每個交易日全日每15秒更新一次；
- (f) 子基金於最後收市時的資產淨值及於最後收市時的每基金單位資產淨值，均以港元表示；
- (g) 子基金的組成(每日更新一次)；及

¹ 基金單位成交價 0.0027% 的交易徵費由買賣雙方支付。

² 基金單位成交價 0.005% 的交易費由買賣雙方支付。

(h) 參與交易商及莊家的最新名單。

相關指數的實時更新資料可透過其他金融數據供應商取得。有關相關指數的附加及最近更新的資料(包括但不限於相關指數計算方法說明、相關指數成分的更改、相關指數編製及計算方法的更改)可透過經理人的網址及指數提供者的網址(該等網址與本概要或基金章程所述的任何其他網址的內容並未經證監會審核)取得。有關就該網址所載資料的警告及免責聲明，請參閱「網站資料」一節。

詳情請參閱基金章程。

重要提示

閣下如有疑問，應諮詢專業意見。

證監會對本概要的內容並不承擔任何責任，對其準確性或完整性亦不作出任何陳述。