

重要提示：香港聯合交易所有限公司（「**聯交所**」）、香港交易及結算所有限公司（「**港交所**」）、香港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告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不會對本公告全部或任何部分內容產生或因依賴該等內容而引致之任何損失承擔任何責任。

經理人對本公告於刊發之日所載資料之準確性承擔全部責任，並於作出一切合理查詢後確認，據其所知及所信，本公告並無遺漏其他事實，以致當中所載任何陳述具有誤導成分，及本公告所表述的意見乃經周詳審慎考慮後達致。

證監會認可不等於對一項計劃作出推介或認許，亦非對該計劃的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的投資者。

如閣下對本公告的內容有任何疑問，務請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。

BMO 亞洲美元投資級別債券 ETF

股票代號：3141

BMO 香港銀行股 ETF

股票代號：3143

BMO 亞洲高息股票 ETF

股票代號：3145

BMO MSCI 日本股票（美元對沖）ETF

股票代號：3160

BMO MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF

股票代號：3165

BMO MSCI 亞太區房地產 ETF

股票代號：3121

BMO 納斯達克 100 ETF

股票代號：3086

（BMO ETF的子基金。BMO ETF是一項根據香港法例第571章證券及期貨條例第104條獲認可的香港傘子單位信託）

（個別稱為「子基金」，合稱「各子基金」）

公告

**指數提供者名稱及指數定價來源的變更、跟蹤偏離度的更新及
有關流通性風險管理及自動交換財務賬戶資料的更新披露**

BMO Global Asset Management (Asia) Limited作為各子基金的經理人（「**經理人**」）謹通知單位持有人以下事項：(i) BMO亞洲美元投資級別債券ETF（「**債券ETF**」）的指數提供者名稱及指數定價來源的變更；(ii) 跟蹤偏離度的更新；及 (iii) 有關流通性風險管理及自動交換財務賬戶資料的更新披露。各子基金的基金章程及產品資料概要（「**產品資料概要**」）經已作出修訂，以反映該等變更。

除非本公告另行訂明，本公告所用詞彙與各子基金日期為2017年3月14日之基金章程（「基金章程」）所界定者具相同涵義。

(1) 指數提供者名稱及指數定價來源的變更

經理人謹通知單位持有人，作為債券ETF相關指數的彭博巴克萊亞洲美元投資級別債券指數（「指數」），其指數提供者Barclays Risk Analytics and Index Solutions Limited 被Bloomberg L.P. 完成收購後，已由2016年8月24日起改名為Bloomberg Index Services Limited（「BISL」）。因此，基金章程內有關指數許可安排的披露（包括指數提供者免責聲名）經已更新。

此外，指數的定價來源亦已由Barclays Bank PLC 改為BISL。在此之前，指數的證券價格每日於下午5:30（新加坡時間）更新，指數內的債券由Barclays Bank PLC按買入價定價。由2016年12月2日起，指數的證券價格每日於下午3時正（紐約時間/東部標準時間）更新，指數內的債券由BISL運用彭博估值（BVAL）定價服務，按買入價定價。BVAL估值方法使用廣泛的全球市場觀察數據組，結合市場領先的分析以及條款和條件數據庫，以產生客觀的第三方價格評估。

BISL 已確認，除上述變更外，指數的日常管理並無任何變化。經理人相信：(i) 上述變更不構成對指數或債券ETF的重大變更；(ii) 債券ETF的整體風險狀況在上述變更後並不會有重大變動或增加；及(iii) 上述變更並不對債券ETF的投資者的權利或權益造成重大不利影響。

(2) 年度跟蹤偏離度之更新

相關的產品資料概要經已修訂，以反映：

- (i) 債券ETF、BMO香港銀行股ETF及BMO亞洲高息股票ETF的更新實際年度跟蹤偏離度，其更新依據截至2016年12月31日的曆年間的實際跟蹤偏離度；及
- (ii) BMO MSCI 日本股票（美元對沖）ETF、BMO MSCI歐洲優勢股票（美元對沖）ETF、BMO MSCI 亞太區房地產ETF及 BMO 納斯達克100 ETF的更新預計年度跟蹤偏離度，其更新依據相關子基金推出日期（即2016年2月18日）至2017年2月17日的12個月期間的實際跟蹤偏離度。

債券ETF、BMO香港銀行股ETF、BMO亞洲高息股票ETF、BMO MSCI日本股票（美元對沖）ETF及BMO MSCI歐洲優勢股票（美元對沖）ETF於截至2016年12月31日或2017年2月17日（以適用者為準）為止的相關期間的實際或預計年度跟蹤偏離度，偏離於先前披露的實際或預計年度跟蹤偏離度。實際或預計年度跟蹤偏離度與其先前刊載的數字之間的差異，相信是基於額外的交易開支以及（就相關投資組合以美元計價的債券ETF、BMO MSCI日本股票（美元對沖）ETF及BMO MSCI歐洲優勢股票（美元對沖）ETF而言）港元對美元的匯率波動。有關實際跟蹤偏離度的最新資料，投資者應參閱各子基金的網站。

(3) 流動性風險管理

根據證監會於2016年7月4日發出的致證監會認可基金的管理公司有關流動性風險管理的通函，基金章程經已更新，以包含有關經理人的流動性風險管理政策及程序的披露。

(4) 自動交換金融帳戶資料

《稅務(修訂)(第3號)條例》於2016年6月30日起生效。這是在香港實施自動交換金融帳戶資料（「AEOI」）標準的法律框架。AEOI 要求香港的金融機構（「金融機構」）蒐集在金融機構持有帳

戶的海外稅務居民的資料，並與該賬戶持有人屬其居民的司法管轄區交換該等資料。一般而言，稅務資料只會向與香港簽訂主管當局協定的伙伴司法管轄區進行交換。然而，信託、各子基金及/或其代理人可進一步蒐集其他司法管轄區居民的相關資料。

信託須遵守香港實施的AEOI規則的規定，意思是信託、各子基金及/或其代理人須蒐集並向稅務局提供與單位持有人及準投資者有關的所需資料。

基金章程已因此就有關AEOI的披露作出更新。進一步資料請參閱基金章程，包括「自動交換金融帳戶資料」一節。每名單位持有人及準投資者應就AEOI對其在子基金的現有或建議進行的投資產生的行政及實體影響諮詢自身的專業顧問。

經修訂之基金章程

基金章程（包括產品資料概要）經已作出修訂，以反映上述變更以及各子基金更新的參與交易商及莊家名單及債券ETF、BMO香港銀行股ETF及BMO亞洲高息股票ETF於2016曆年的過往表現資料。

各子基金經修訂之基金章程及產品資料概要，經已刊登於信託的網站（www.bmo.hk/etfs）（該網址的內容並未經證監會審核）及港交所的網站（www.hkex.com.hk）。

倘閣下對本公告或各子基金有任何疑問，請於辦公時間聯絡經理人進行查詢（地址：香港中環交易廣場第一座36層及3808室，熱線電話：+852 3716-0990）。

BMO Global Asset Management (Asia) Limited

作為各子基金的經理人

2017年3月14日