

# BMO MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF

3165 HK

截至2018年12月31日

**重要提示:** BMO MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF是BMO ETF傘子單位信託組成的子基金。投資子基金可能涉及佣金、管理費及有關開支。子基金可能不適合所有投資者，投資者不應只按照此文件內容而作出任何投資決定。投資者應審慎投資，詳細閱讀BMO ETF基金章程（可在網址www.bmo.hk/tc 閱覽）以獲得更多資料，包括產品的特點及風險因素。ETF並不獲保證。投資價值會隨股票市場和匯率波動而變動，投資者可能無法收回投資的全部金額。

- 子基金旨在提供在扣除費用及開支之前盡量貼近MSCI歐洲高質量公司指數（100% 美元對沖）表現的投資業績。
- 子基金主要投資於歐洲股票，並因追蹤單一地區（歐洲）而具有集中投資的風險。集中投資比多樣化的投資面臨的波動為大，子基金較容易受歐洲不利的情况影響而導致價值波動。
- 子基金投資於貨幣遠期合約作對沖用途。雖然此方法旨在盡量減低貨幣波動對基金回報的影響，子基金仍要承擔對沖費用、衍生工具和場外交易的風險。
- 當歐洲證券交易所的開放時間正值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。
- 相對於每基金單位的資產淨值，子基金的交易價格可能有顯著的溢價或折讓。
- 基於費用及開支以及基金經理採用之具代表性抽樣策略等因素，子基金之資產淨值變動或會與指數表現有所偏差。

## 基本資料

|         |  |
|---------|--|
| 經理人     | BMO Global Asset Management (Asia) Ltd |
| 信託人     | Cititrust Limited                      |
| 上市日期    | 2016年2月18日                             |
| 交易所     | 香港聯交所                                  |
| 指數      | MSCI 歐洲高質量公司指數 (100%美元對沖)              |
| 彭博代號    | 3165.HK                                |
| 指數代號    | M1CXBMEQ                               |
| ISIN    | HK0000281003                           |
| 淨資產(港元) | 53,956,572                             |
| 每手買賣單位  | 200                                    |
| 持續繳付的費用 | 0.50%                                  |
| 交易貨幣    | 港元                                     |
| 派息次數    | 每半年                                    |

## 投資目標

BMO MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF旨在盡量貼近MSCI 歐洲高質量公司指數（100%美元對沖）的投資業績（在扣除費用及開支之前）。

## 投資優勢

作為香港第一隻美元對沖的歐洲股票ETF產品，BMO MSCI 歐洲優勢股票（美元對沖）ETF將為您提供：

- 廣泛投資於14個歐洲市場及超過120隻優質藍籌公司股票
- 聰明啤打（“Smart beta”）的投資策略幫助識別穩定收益增長、低財務槓桿和高利潤率的優質公司
- 覆蓋多個行業，以消費品和工業為重
- 貨幣對沖的ETF產品可以減少投資者在投資歐洲股票時受到歐元波動影響

## 指數介紹

MSCI歐洲高質量公司指數（100%美元對沖）是持股量調整修正的市值加權指數包含股票投資成分及貨幣對沖回報成分。

基金將投資於MSCI 歐洲高質量公司指數的現有成分股，並對沖美元的外幣風險旨在捕捉貨幣對沖對下MSCI歐洲指數中優質增長股的表現。優質策略是跟據三大基本因數：高股本回報率（「ROE」）、穩定的按年收益增長率及低資本負債比率，成分證券包括歐洲各國已發展市場的大型及中型資本股。

相關指數於2015年5月15日推出，並以美元計值。相關指數於5月及11月每半年檢討及重新調整。經理人按月重新調整貨幣對沖策略。

## 基金特點

|                         |       |
|-------------------------|-------|
| 股票數目                    | 124   |
| 指數市值(單位：10億美元)          | 2,550 |
| 市盈率                     | 17.58 |
| 市淨率                     | 4.43  |
| 投資組合收益率(%) <sup>1</sup> | 3.31  |

## 累積表現



## 累積表現(%)

|    | 1個月    | 3個月    | 6個月    | 1年     | 自成立以來* |
|----|--------|--------|--------|--------|--------|
| 基金 | -4.31% | -9.31% | -6.64% | -5.41% | 23.93% |
| 指數 | -4.27% | -9.27% | -6.25% | -5.00% | 25.72% |

## 歷年表現(%)

|    | 年初至今 <sup>^</sup> | 2017   | 2016*  |
|----|-------------------|--------|--------|
| 基金 | -5.41%            | 15.97% | 12.98% |
| 指數 | -5.00%            | 15.77% | 14.31% |

請注意：基金表現根據基金單位資產淨值，按港元計算，包括股息再投資。此數據顯示，基金價值在該時期內的升跌幅度。表現數據以港元計，包括持續性的費用。<sup>^</sup>基金表現截至2018年12月31日 \*基金於2016年2月12日成立。

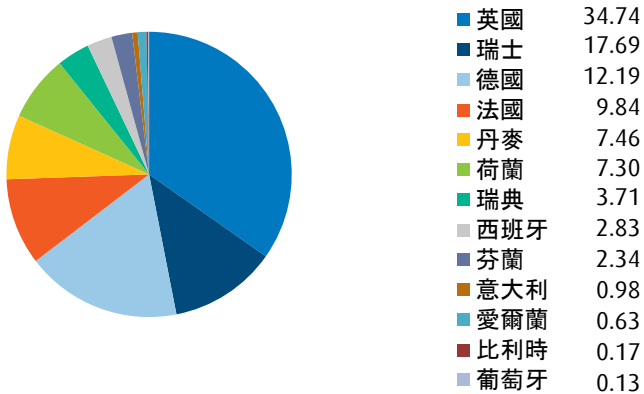
1- 過去12個月內組合持有股票加權平均的總股息收入，除以組合持有股票的總市值。資料來源：彭博。

# BMO MSCI 歐洲優勢股票 (美元對沖) ETF

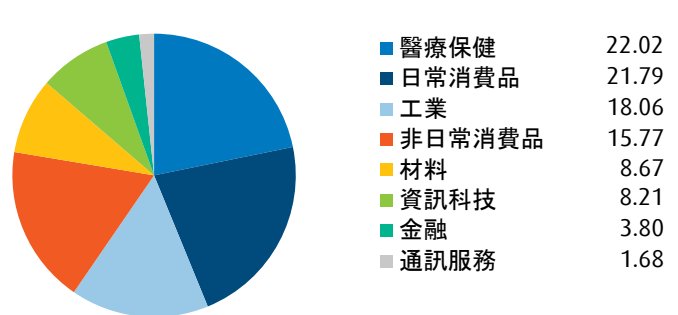
3165 HK

截至2018年12月31日

## 國家/地區 (%)



## 行業 (%)



## 基金十大持股 (%)

|   |      |
|---|------|
| 羅氏大藥廠 (Roche Holding AG)                | 5.12 |
| 諾和諾德公司 (Novo Nordisk A/S)               | 5.07 |
| 雀巢 (Nestle SA)                          | 4.99 |
| 葛蘭素史克公開有限公司 (GlaxoSmithKline PLC)       | 4.85 |
| 阿斯特捷利康公開有限公司 (AstraZeneca PLC)          | 4.17 |
| 聯合利華 (Unilever NV)                      | 3.98 |
| 思愛普 (SAP SE)                            | 3.55 |
| 帝亞吉歐公開有限公司 (Diageo PLC)                 | 3.51 |
| 路易威登 (LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton) | 3.11 |
| 聯合利華公司 (Unilever PLC)                   | 2.80 |

## 參與交易商

|   |
|---|
| ABN AMRO Clearing Hong Kong Limited     |
| BNP Paribas Securities Services         |
| Goldman Sachs (Asia) Securities Limited |
| 海通國際證券有限公司                              |
| 麥格理銀行有限公司                               |
| 法國興業證券(香港)有限公司                          |

## 市場莊家

|                                       |
|---------------------------------------|
| BNP Paribas Securities (Asia) Limited |
| Commerz Securities Hong Kong Limited  |

## 卓越成就榮耀

|                    |                                    |
|--------------------|------------------------------------|
| 最佳Smart Beta 投資策略獎 | 亞洲資產管理 2018 Best of the Best 大獎    |
| 年度ETF供應商           | 2017《指標》香港年度基金大獎                   |
| 基金公司大獎 - 最具創新ETF大獎 | 2017《指標》香港年度基金大獎                   |
| 同級最具創新ETF 供應商      | 2016《指標》香港年度基金大獎                   |
| 最佳 ETF 基金經理 (香港)   | 亞洲資產管理 2016 年度 Best of the Best 大獎 |
| 香港最佳 ETF 供應商       | 2016 年《財資》Triple A ETF 獎項          |
| 亞洲最佳 ETF 供應商       | Wealth & Finance 2016 基金大獎         |
| 香港最佳ETF供應商：明日之星    | 2015年《財資》Triple A ETF大獎            |

+852 3716-0990

bmogamasiainfo@bmo.com

www.bmo.hk/tc

### 免責聲明

本文件的任何內容並不構成購買或出售任何投資的要約、提議或建議，本文件無意發放給其法律或法規不容許提供和使用本文件內容的任何司法管轄區或國家的任何人士或實體。投資者應清楚了解並遵守所適用的任何司法管轄區或國家的法律和法規。投資者應尋求專業人士關於個別投資的意見。本文件由BMO Global Asset Management (Asia) Ltd編製，並未經香港證券及期貨事務監察委員會審閱。BMO Global Asset Management (Asia) Ltd為香港證券及期貨事務監察委員會核准及監管。

本中文本為翻譯本，僅供收件人參考。中文譯本與英文版本不一致時，以英文版本為準。