

重要资料：请务必仔细阅读本公告。如阁下对本公告的内容有任何疑问，应寻求独立专业意见。

**关于摩根亚洲股息基金
采用摆动定价机制
以及修改基金文件的公告**

摩根亚洲股息基金（以下简称“本基金”）于2019年1月24日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]125号文获准在中国内地注册及销售，并自2019年3月1日在中国内地公开销售。现摩根基金（亚洲）有限公司（以下简称“基金管理人”）将对本基金适用于内地销售的基金文件（包括简体中文版信托契约（含基础条款）以及《摩根亚洲股息基金基金说明书》（以下简称“《基金说明书》”）和《产品资料概要》（以下将《基金说明书》和《产品资料概要》合称为“销售文件”））进行修改。本公告旨在告知内地投资者有关本基金基金文件的以下变更，除非下文另有说明，否则该等变更将自2022年7月25日（包括该日在内）（以下简称“生效日期”）起生效。

一、 有关适用于份额净值的调整机制的变更

本基金的信托契约赋予基金管理人调整本基金份额净值的权力，以反映管理人估计本基金为应付申购或赎回要求而买卖相关证券将会导致的财务费用（以下简称“调整机制”）。调整机制的目的是在特殊情况下（包括但不限于在相关市场出现高波幅及／或缺乏流通性），当本基金份额的交易将可能对现有投资者的利益有潜在影响（以下简称“摊薄影响”）时，保护本基金所有投资者的利益。

（一） 调整机制的变更

为了使调整机制能够更好地实现保护本基金的投资者免受预期摊薄影响的目的，本基金的调整机制将自生效日期起（包括该日在内）作出以下变更。

1. 可运用调整机制的情况

目前，本基金的销售文件载明，在特殊情况下，包括但不限于在相关市场出现高波幅及／或缺乏流通性，本基金的份额的大额交易将可能对现有份额持有人的利益有潜在影响，则基金管理人可运用调整机制。

自生效日期起，本基金的销售文件将作出修订，以载明当本基金的资金净流动超过基金管理人不时预先确定的限额时，倘若基金管理人认为符合所有份额持有人的利益，基金管理人可作出摆动定价调整。该等限额由基金管理人根据一系列因素确定，包括但不限于本基金的资产流动以及相关市场的流通性。可能导致资金净流动情况的例子包括由于申购／赎回要求、基金合并（其中涉及本基金资产的流入／流出）等而导致的份额净交易。该等修订将允许在更多出现预期摊薄影响的情况下运用调整机制，从而为现有份额持有人提供更好的保护。

2. 上调最高调整比率

目前，本基金的销售文件载明，除非在极端市场状况下，否则调整比率将不会超过本基金有关类别份额净值的1%。

自生效日期起，销售文件将作出修订，以载明在正常市况下，调整比率将不会超过有关类别份额净值的2%；然而，在极端市况下（例如在出现高波幅、资产流通性下降及市场受压的期间），该比率可能大幅上升。在任何情况下，除非获得受托人及香港证券及期货事务监察委员会（以下简称“香港证监会”）（如要求）的批准，否则只能暂时性地适用超过2%的摆动定价调整比率，且该等比率将不会超过5%。

3. 更改调整机制的名称及澄清其目的

调整机制的名称将改为“摆动定价”（目前在现行销售文件内称为“财务费用”），并且本基金的销售文件将作出澄清，以表明调整机制的目的是当本基金出现资金净流动时，降低因购买／出售相关投资所导致的预期摊薄影响（包括但不限于买卖差价及交易费用，如经纪费、税项及政府收费）。

(二) 内地基金文件将作出的修订

1. 销售文件的修订

(1) 《基金说明书》之修订

“第一章 本基金的内地补充规则”之修订

- “一、香港互认基金的特别说明和风险揭示”下“(六) 适用于内地投资者的交易及结算程序”之“6. 本基金申购、赎回与转换的规则”一节内第(2)项“申购份额的计算”倒数第三段、第(3)项“赎回金额的计算”倒数第三段及第(9)项“份额转换”之“(iii) 转入份额的计算”的最后一段全部删除，并以下文取代：

“[^]倘若管理人认为符合所有份额持有人的利益，在计算份额净值时，当本基金的资金净流动超过管理人不时预先确定的限额时，管理人可（当本基金发生资金净流入时）上调或（当本基金发生资金净流出时）下调份额净值，以降低因购买／出售相关投资所导致的预期摊薄影响，包括但不限于买卖差价及交易费用，如经纪费、税项及政府收费。可能导致资金净流动情况的例子包括由于申购／赎回要求、基金合并（其中涉及本基金资产的流入／流出）等而导致的份额净交易。在正常市况下，该等摆动定价调整比率将不会超过各类别份额净值的2%。然而，在极端市况下（例如在出现高波幅、资产流通性下降及市场受压的期间），该比率可能大幅上升。在任何情况下，除非获得受托人及香港证监会（如要求）的批准，否则只能暂时性地适用超过2%的摆动定价调整比率，且该等比率将不会超过5%。”

- “五、其他较之香港投资者获得的存在重大差异或者对内地投资者有重大影响的信息”下“(三) 本基金须持续缴付的费用”之“3. 财务费用”一节全部删除。

“第二章 本基金的基本规定”之“第A节 – 摩根亚洲股息基金基金说明书”之修订

- 于“估值基准”一节后插入以下内容作为新的一节：

“摆动定价

倘若管理人认为符合所有份额持有人的利益，在计算份额净值时，当本基金的资金净流动超过管理人不时预先确定的限额时，管理人可（当本基金发生资金净流入时）上调或（当本基金发生资金净流出时）下调份额净值，以降低因购买／出售相关投资所导致的预期摊薄影响，包括但不限于买卖差价及交易费用，如经纪费、税项及政府收费。可能导致资金净流动情况的例子包括由于申购／赎回要求、基金合并（其中涉及本基金资产的流入／流出）等而导致的份额净交易。

在正常市况下，该等摆动定价调整比率将不会超过各类别份额净值的2%。然而，在极端市况下（例如在出现高波幅、资产流通性下降及市场受压的期间），该比率可能大幅上升。在任何情况下，除非获得受托人及香港证监会（如要求）的批准，否则只能暂时性地适用超过2%的摆动定价调整比率，且该等比率将不会超过5%。”

- “申购”一节内“份额之发行”分节最后一段全部删除，并以下文取代：

“管理人将保留申购费拨归其所有或使用。”

- “申购”一节内“申请手续”分节倒数第二段的最后一句全部删除，并以下文取代：

“在该情况下，管理人将有权向申请人收取代表处理申购申请所涉及之费用之注销费（该收费归管理人所拥有）及任何货币汇兑成本（如适用），并可要求该申请人向管理人支付份额获发行之日与份额被注销之日之份额净值（经摆动定价机制所调整（如适用））之差额，以及任何适用之申购费及赎回费。”

- “赎回”一节内“份额之赎回”分节最后一段全部删除，并以下文取代：

“管理人将保留赎回费之款项拨归其所有或使用。然而，管理人现时并无征收任何赎回费。”

- “收费、开支及责任”一节内“财务费用”分节全部删除。

- “一般资料”一节内“流动性风险管理”分节第二段最后一句全部删除，并以下文取代：

“该等工具（包括但不限于公平估值、摆动定价调整及暂停赎回）旨在减低流动性风险的影响，但其可能无法为投资者完全消除流动性风险。”

- “一般资料”一节内“流动性风险管理”分节倒数第二段全部删除，并以下文取代：

“有关本基金的流动性风险管理工具的进一步详情（即公平估值、摆动定

价调整及暂停赎回），请参阅本基金说明书第二章第A节内的‘估值基准’一节、‘摆动定价’一节以及‘赎回’一节之‘暂停赎回’分节。”

(2) 《产品资料概要》之修订

本基金的《产品资料概要》将进行修订，以反映上述《基金说明书》中关于申购份额的计算、赎回金额的计算及转入份额的计算的公式中相关内容的修订。

2. 信托契约（含基础条款）的修订

本基金的信托契约亦将通过一份经修订及重述信托契约作出修订，以反映上述变更（如适用）。具体包括：

- (1) 修订基础条款第21.1(D)条、第22.1(A)(ii)条和第22.1(E)条，删除财务费用相关内容；
- (2) 修订基础条款第23.2条，删除财务费用相关内容并增加摆动定价机制的内容。

二. 本基金在香港端的有关申购款项、赎回所得款项及收益分配支付方式的变更

本基金在香港端的销售将进行以下变更，该等变更并不适用于本基金在内地的销售：

(一) 有关申购款项支付方式的变更

就本基金在香港的销售而言，目前，除非基金管理人另行同意，否则直接通过基金管理人申购基金份额的投资者¹应以电汇／银行转账向基金管理人支付申购基金份额的款项。在有限的情况下并获基金管理人同意后，款项可按照本基金销售文件所载规定以支票支付。

为了推广使用电汇／银行转账，基金管理人自生效日期起将不再接受以支票支付申购款项。

申请人须缴付电汇／银行转账所产生的任何银行或其他行政费用。申购款项应扣除任何银行费用及其他行政费用。

内地投资者请注意，以上变更不适用于内地投资者。内地投资者应通过内地销售机构办理本基金的申购，申购款项的支付方式应采用银行转账及内地销售机构认可的其他方式。

(二) 有关赎回所得款项及收益分配支付方式的变更

就本基金在香港的销售而言，目前，本基金的赎回所得款项及收益分配（如有及如未再投资）是根据份额持有人就此目的提供之付款详情以电汇／银行转账支付给直接通过基金管理人买卖其份额的份额持有人¹。如份额持有人并无提供银行付款详情或如基金管理人另行同意，受限于有关银行的安排，则赎回所得款项及收益分配款项可以支票支付。

¹ 就本基金在香港的销售而言，本基金的《基金说明书》第二章“本基金的基本规定”及本公告所载的买卖手续只适用于通过基金管理人进行的买卖。其他香港销售机构可能有不同的买卖手续。因此，有意通过基金管理人以外的香港销售机构申购、赎回或转换份额的香港投资者，应咨询有关香港销售机构，了解适用于该等香港销售机构的买卖手续。

内地投资者仅通过内地销售机构买卖本基金，本公告所载的款项支付方式变更不适用于内地投资者。本基金在内地销售的买卖手续以内地销售机构的规定为准，相关说明载列于本基金的《基金说明书》第一章“本基金的内地补充规则”。

为了推广使用电汇／银行转账，基金管理人自生效日期起将不再以支票支付赎回所得款项及收益分配。如份额持有人并无提供银行付款详情以进行电汇／银行转账或如所提供的银行付款详情不正确，则该赎回要求将不会被视作妥为提交的要求，而只有当份额持有人提供正确的银行付款详情后，基金管理人方会支付赎回所得款项，并且收益分配将继续自动再投资于申购本基金相应份额类别的更多份额，除非基金管理人认为份额持有人申购更多份额可能对本基金产生不利的监管、税务或财政后果，或可能在其他情况下损害本基金的利益。

因此，如份额持有人于生效日期前并未提供正确的银行付款详情以进行电汇／银行转账，则于生效日期后，赎回所得款项将会被保留并且收益分配将会自动再投资，或如属前段所述并不适合进行再投资的情况，则收益分配将会被保留。特别是，份额持有人应确保其于生效日期前留存于基金管理人的银行付款详情为多币种银行账户，以便以相关货币计价的赎回所得款项及收益分配能够支付至其银行账户。

份额持有人可能因电汇／银行转账付款而须缴付任何银行费用。

内地投资者请注意，以上变更不适用于内地投资者。内地投资者应通过内地销售机构办理本基金的赎回，赎回所得款项的支付方式应采用银行转账及内地销售机构认可的其他方式。就本基金在内地销售的每月派息类份额类别而言，内地投资者将以现金形式取得收益分配，现金收益分配款项通常将通过内地销售机构以内地销售机构和内地投资者指定的支付方式支付。

本基金的销售文件亦将作出澄清，以载明任何于付款日期起六年后仍未领取之收益分配将被没收，并成为有关类别资产之一部分（或如有关类别已被终止，则成为基金资产之一部分）。例如，如份额持有人将收益分配再投资可能对本基金产生不利的监管、税务或财政后果，或可能在其他情况下损害本基金的利益，及份额持有人并未提供正确的银行付款详情以进行电汇／银行转账，则于付款日期起六年后，该收益分配将被没收，并成为有关类别资产之一部分。

三. 其他变更

(一) 有关收益分配再投资的澄清

本基金的销售文件将作出澄清，以载明如基金管理人认为份额持有人申购更多份额可能对本基金产生不利的监管、税务或财政后果，或可能在其他情况下损害本基金的利益，则该份额持有人将会收取收益分配款项而非让收益分配自动再投资于申购更多份额。

内地投资者请注意，以上变更不适用于内地投资者。就本基金目前在内地销售的派息份额类别而言，内地投资者将以现金形式取得分配。

(二) 有关适用于收益分配的认证程序的澄清

本基金的销售文件将作出澄清，以载明基金管理人可酌情就收益分配款项的支付开展任何其认为适当的认证程序。认证程序旨在为本基金、其代理人或份额持有人降低错误及欺诈风险。倘若未能完成令基金管理人满意的任何认证程序，基金管理人可将付款指令的处理推迟至晚于原定收益分配款项支付之日的日期，即当已完成令其满意的认证程序时的日期才予以处理。

倘若基金管理人有任何验证、确认或认证程序下的其他流程不满意，其可拒绝执行相关收益分配款项的支付，直至有关验证、确认或认证程序下的其他流程令其满意为止。倘若基金管理人在上述情况下推迟执行或拒绝执行收益分配款项的支付，基金管理人或本基金不就此对份额持有人或任何人承担任何责任。

(三) 就以电子方式发送文件而对本基金信托契约的修订

自生效日期起，本基金的信托契约将作出修订，以提供可以电子方式向份额持有人发送与本基金有关的通知、通讯或其他文件（以下合称“产品文件”）的灵活性（以下简称“电子发送安排”）。

就本基金在香港的销售而言，对于通过基金管理人投资于本基金的投资者，基金管理人并无实施电子发送安排的具体时间表，投资者将继续收取纸质形式的产品文件。在采用电子发送安排前，投资者将另行收到事先通知。

就本基金在香港的销售而言，对于通过其他香港销售机构投资于本基金的投资者，由于各香港销售机构的安排可能有所不同，投资者应联系有关香港销售机构，了解适用于投资者的电子发送安排的程序。

内地投资者请注意，以上变更不适用于内地投资者。就本基金在内地的销售而言，本基金应予披露的基金信息应通过内地代理人的网站(www.cifm.com)等媒介披露，并保证能够按照本基金销售文件约定的时间和方式查阅或复制公开披露的信息资料。

(四) 本基金信托契约的其他修订

本基金的信托契约内有关修改信托契约的条款将作出修订，以更好地与现行法规保持一致，自本公告发布之日起生效。

(五) 本基金销售文件的强化披露

本基金的销售文件将作出其他强化披露及杂项修订，包括风险披露。

四. 变更的影响

除上文披露的内容外，适用于本基金的特征及风险不会受到任何影响，本基金的运作及／或管理方式或管理本基金的费用水平／成本亦不会发生任何改变。上述变更将不会对本基金现有投资者的利益造成重大损害。

与上述第一部分及第二部分所述变更相关的法律及其他行政成本估计约为64,500美元及12,900美元，将由本基金及摩根基金（单位信托系列）下的其他经中国证监会准予在内地注册及公开销售的香港互认基金平均承担。

本基金在内地销售的份额类别不收取赎回费。内地投资者如因上述变更赎回其持有的本基金的基金份额，无需支付赎回费。

五. 文件的查阅

本基金现行的基金文件可通过内地代理人的网站(www.cifm.com)查阅，并可于正常办公时间在内地代理人的营业场所免费查阅，也可在支付合理工本费后索取复印件。

反映上述修订的本基金经修订及重述的信托契约以及经修订的销售文件将分别于本公告发布之日及生效日期当日或之后通过内地代理人的网站(www.cifm.com)披露，并可于正常办公时间在内地代理人的营业场所免费查阅，也可在支付合理工本费后索取复印件。

六. 重要提示

1. 投资者在办理基金交易前，请仔细阅读登载在内地代理人的网站(www.cifm.com)的本基金的《基金说明书》《产品资料概要》及《信托契约》等相关法律文件及公告，并确保遵循其规定。若《基金说明书》《产品资料概要》内容与本公告内容有不一致之处，应以本公告内容为准。
2. 本基金作为香港互认基金，其投资运作、风险收益特征、法律法规适用与内地基金产品不同，敬请投资者认真阅读上述法律文件及公告中的风险揭示内容，谨慎做出投资决策。
3. 风险提示：投资涉及风险。投资前请参阅销售文件所载详情，包括本基金的主要风险及香港互认基金的特有风险。投资价值及收益可出现波动，投资者的投资并无保证，过去的业绩并不预示未来表现。汇率波动可导致有关海外投资的价值升跌。本基金为内地与香港基金互认中获得中国证监会正式注册的香港基金，在内地市场向公众销售，中国证监会的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断、推荐或者保证。

七. 投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

上投摩根基金管理有限公司
客服电话：400-889-4888
网址：www.cifm.com

基金管理人就本公告内容之准确性承担责任。

特此公告。

基金管理人：摩根基金（亚洲）有限公司

二〇二二年六月十三日