

关于摩根士丹利基金-沪港深 1 号集合资产管理计划 合同条款变更及生效的公告

摩根士丹利基金-沪港深 1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2022 年 2 月 10 日成立。根据 2023 年 3 月 1 日实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》，及《摩根士丹利基金-沪港深 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化需要变更资产管理合同，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。为执行上述法规要求，摩根士丹利基金管理（中国）有限公司拟对本计划的资产管理合同条款做出相应变更，具体内容如下：

合同修改对比表：

修改要点	原条款	调整后
第四章“当事人及权利义务”第三节“资产托管人”中第 3 点“资产托管人的义务”中增加第（15）条关联方信息提供相关内容		增加第（15 条）： （15）自身及其控股股东、实际控制人或者其他关联方名单发行或者承销的证券、设立的资产管理产品的明细信息，并根据资产管理人不时更新的关联交易认定标准补充提供所涉及关联方等相关信息。
第八部分“本计划的参与、退出与转让”第十一节“资产管理人自有资金参与”中增加取得同意的描述	（十一）资产管理人自有资金参与 资产管理人以自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知资产委托人和资产托管人。资产管理人以自有资金参与资产管理计划的，同等份额与资产委托人享受同等权利和义务，	（十一）资产管理人自有资金参与 资产管理人以自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知资产委托人和资产托管人，并取得其同意。资产管理人以自有资金参与资产管理计划的，同等份额与资产委托人享受同等权利和义务，其参与、退出的开放期为本计划的开放期。



	<p>其参与、退出的开放期为本计划的开放期。</p>	
<p>第十一部分 “资产管理计划的投资”第五节“投资限制”按新规修订，并增加第七点限制；第七节中增加第九-13点投资禁止事项</p>	<p>(五) 投资限制</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、在每个交易日日终，权益类资产市值占本计划总资产的 0-80%（不含）； 2、在每个交易日日终，港股通标的股票资产市值占本计划总资产的 0-80%（不含）； 3、在每个交易日日终，固定收益类资产市值占本计划总资产的 0-80%（不含）； 4、在每个交易日日终，本计划持有的股指期货多头合约价值和空头合约价值之和的绝对值占本计划总资产的比例为 0-80%（不含 80%；其中，多头合约价值为正值，空头合约价值为负值）； 5、本计划参与股票、债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时，单个计划所申报的金额不得超过该计划的总资产，单个计划所申报的数量不得超过拟发行证券公司本次发行证券的总量； 6、本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%；本管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外； 7、本计划总资产不得超过本计划净资产的 200%。 	<p>(五) 投资限制</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、在每个交易日日终，权益类资产市值占本计划总资产的 0-80%（不含）； 2、在每个交易日日终，港股通标的股票资产市值占本计划总资产的 0-80%（不含）； 3、在每个交易日日终，固定收益类资产市值占本计划总资产的 0-80%（不含）； 4、在每个交易日日终，本计划持有的股指期货多头合约价值和空头合约价值之和的绝对值占本计划总资产的比例为 0-80%（不含 80%；其中，多头合约价值为正值，空头合约价值为负值）； 5、本计划参与股票、债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时，单个计划所申报的金额不得超过该计划的总资产，单个计划所申报的数量不得超过拟发行证券公司本次发行证券的总量； 6、本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%；本管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外； 7、本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产 50%时，计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。 8、本计划总资产不得超过本计划净资产的 200%。 <p>由于证券期货市场波动、证券发行人合并、计划资产规模变动、投资品种相关评级变动等管理人之外的原</p>

	<p>由于证券期货市场波动、证券发行人合并、计划资产规模变动、投资品相关评级变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例限制的，管理人应在相关证券可交易之日起 15 个工作日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>（七）投资禁止 本合同委托财产的投资禁止行为包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、承销证券； 2、违反规定向他人贷款或者提供担保； 3、从事承担无限责任的投资； 4、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动； 5、不得直接投资于商业银行信贷资产； 6、不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保； 7、不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域； 8、不得直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外）； 	<p>因导致的投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例限制的，管理人应在相关证券可交易之日起 20 个工作日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>（七）投资禁止 本合同委托财产的投资禁止行为包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、承销证券； 2、违反规定向他人贷款或者提供担保； 3、从事承担无限责任的投资； 4、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动； 5、不得直接投资于商业银行信贷资产； 6、不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保； 7、不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域； 8、不得直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外）； 9、不得利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为资产管理人、资产托管人、投资顾问及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资； 10、不得为资产管理人、资产托管人、投资顾问或他人违规持有金融机构股权提供便利； 11、不得开展明股实债投资； 12、不得通过投资其他资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求；
--	---	--

		<p>13、法律、行政法规、监管机构和自律组织和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>如法律、行政法规、监管机构和自律组织取消上述禁止性规定，则本资产管理计划可不受上述规定的限制。</p>
<p>第十四章“利益冲突及关联交易”按照一般关联交易和重大关联交易分层管理</p>	<p>(一) 关联交易及利益冲突情形</p> <p>在合同约定的投资范围内，资产管理人运用委托财产投资于管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方承销期内承销的证券，以及托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。</p> <p>(二) 关联交易及利益冲突的应对、处理及披露</p> <p>资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事前文已经明确列明的关联交易情形，资产管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得资产委托人的授权，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。对于资产管理计划在投资运作过程中从事除前述列明情形以外的其他关联交易的，事后应当及时、全面、客观的向资产委托人和托管人进行披露；若该等关联交易构成重大关联交易的，则应当事先取得资产委托人的同意，并应当提</p>	<p>(一) 关联交易及利益冲突情形</p> <p>1、关联方范围</p> <p>(1) 资产管理人及托管人；</p> <p>(2) 资产管理人的控股股东和实际控制人、资产托管人的控股股东和实际控制人；</p> <p>(3) 与资产管理人、资产托管人有其他重大利害关系的公司；其中与资产管理人、资产托管人存在如下关系的公司视为与资产管理人、资产托管人存在其他“重大利害关系”：</p> <p>1) 被资产管理人、资产托管人控制；</p> <p>2) 被资产管理人、资产托管人的控股股东控制；</p> <p>3) 有关法律法规或中国证监会界定的其他情形。</p> <p>(4) 资产管理人的其他股东；</p> <p>(5) 资产管理人管理的其他投资组合。</p> <p>2、一般关联交易和重大关联交易</p> <p>(1) 重大关联交易</p> <p>重大关联交易是指，资产管理人运用计划财产投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，以及中国证监会、基金业协会规定的其他重大关联交易情形。</p> <p>(2) 一般关联交易</p> <p>重大关联交易以外的关联交易为一般关联交易。本计划将投资于资产管理人管理的公募基金，或资产管理人关联方所设立的中国证监会认</p>

	<p>供充分证据证明未损害资产委托人利益。</p> <p>资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持资产委托人利益优先原则，从充分维护资产委托人利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向资产委托人提供的定期报告或临时报告中进行披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对资产委托人利益的影响等。</p> <p>托管人应根据管理人的要求及时提供关联方名单。</p>	<p>可的比照公募基金管理的资产管理产品。</p> <p>一般关联交易包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 投资资产管理人控股股东、实际控制人和与资产管理人具有“重大利害关系”的公司在承销期内作为副主承销商、分销商承销的证券； 2) 投资资产托管人的非控股股东发行、承销的证券； 3) 投资资产管理人管理的公募基金； 4) 通过关联方交易单元进行证券和衍生品交易； 5) 投资于关联方的银行存款； 6) 与关联方作为交易对手进行银行间债券市场的债券（含回购）交易、交易所大宗交易、固定收益交易平台等议价交易； 7) 以关联方发行的债券作为质押券的质押式回购交易； 8) 投资关联方发行的公募基金或中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品。 <p>3、关联交易审批程序</p> <p>投资部门准备相关说明文件，提出投资申请，启动审批流程。投资申请经投资部门负责人、分管领导批准后，交法律事务部、监察稽核部审查。法律事务部、监察稽核部依职责审查该交易的正当性、公允性、合规性，并对是否为“重大关联交易”做出判断。若涉及的关联交易不构成“重大”标准的，法律事务部、监察稽核部审查通过后，投资部门执行。若涉及的关联交易属于重大关联交易，还应按照本合同下述“（二）关联交易及利益冲突的应对及处理”约定的方式事先取得委托人同意。</p> <p>在符合适用法律法规和监管要求的前提下，资产管理人制度规定的一般关联交易中的某些特定类型交易可无需履行上述审批程序。</p>
--	--	---

		<p>4、特别风险提示</p> <p>提示资产委托人注意：虽然资产管理人积极遵循资产委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人运用委托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产委托人的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响委托财产的投资收益。</p> <p>（二）关联交易及利益冲突的应对及处理</p> <p>1、资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事前文已经明确列明的一般关联交易情形，资产管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得资产委托人的逐笔、分别授权，但该等一般关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益，管理人应事后在定期报告中统一向委托人和托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告。若该等关联交易构成重大关联交易的，则应当事先取得资产委托人的同意，并应当提供充分证据证明未损害资产委托人利益。</p> <p>2、对于本计划涉及的重大关联交易事项，为保护资产委托人权益，资产管理人应当提前取得其同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。具体方式为：</p> <p>由资产管理人于资产管理人网站等与委托人约定的方式向资产委托人信息披露，并且资产管理人须在信息披露后5个工作日内以书面或者</p>
--	--	---

	<p>通过资产管理人网站（由资产管理人决定）向本计划资产委托人发送或者刊登征询意见函，资产委托人应在征询意见函指定的日期内按指定的形式回复书面意见，资产管理人采取如下权利保障措施及安排：</p> <p>（1） 资产委托人不同意的，资产管理人保障其退出权利，资产委托人应在征询意见函发出后的3个工作日内或最近一个开放日按照资产管理人届时具体安排提出退出本计划的申请；</p> <p>（2） 资产委托人不同意且逾期未申请退出的，则资产管理人有权在征询意见函中说明的意见回复期届满后将其持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划（退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值），由此发生的相关税费、或有损失由该资产委托人自行承担；</p> <p>（3） 资产委托人在征询意见函规定期限内未回复意见且逾期未退出的，视同该资产委托人同意，资产管理人不再另行通知；</p> <p>（4） 资产委托人回复意见不明确的，则资产管理人有权视为该资产委托人不同意，按照以上（1）、（2）资产委托人不同意的方式处理。</p> <p>3、资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持资产委托人利益优先原则，从充分维护资产委托人利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向资产委托人提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容应当符合法律法规的相关要求。</p> <p>4、本章所列的关联方、重大关联交易与一般关联交易的划分标准，除法律法规强制规定列为关联方、</p>
--	--

		重大关联交易者外，系资产管理人公司制度的规定。如该等制度发生修改或变更导致上述范围调整的，资产管理人将根据本合同约定向委托人披露。
第十八部分 “越权交易的界定” 第三节 “资产托管人对资产管理人的投资监督” 中投资比例限制监督内容中增加第（7）点	（7）本计划总资产不得超过本计划净资产的 200%。由于证券期货市场波动、证券发行人合并、计划资产规模变动、投资品相关评级变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例限制的，管理人应在相关证券可交易之日起 15 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。	增加第（7）条： （7）本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产 50%时，计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。 （8）本计划总资产不得超过本计划净资产的 200%。 由于证券期货市场波动、证券发行人合并、计划资产规模变动、投资品相关评级变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例限制的，管理人应在相关证券可交易之日起 20 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。
第二十四部分 “风险揭示” 第（一）点 “一般风险揭示” 第 9 款 “关联交易风险” 根据相关章节的修订进行充分补充揭示	9、关联交易风险 本计划可能会投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销的证券，或者与其从事其他重大关联交易，因此资产委托人将面临一定的关联交易风险。 虽然资产管理人积极遵循资产委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人运用委托财产从	1) 从事关联交易的风险 本计划可能会投资于资产管理人发行的证券投资基金，以及资产托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司以及其他关联方发行或者承销的证券，或者与其从事其他关联交易，因此资产委托人将面临一定的关联交易风险。 本计划将可能与本合同“利益冲突及关联交易” 章节所规定的关联方开展关联交易。本计划的关联交易区分一般关联交易和重大关联交易，重大关联交易是指资产管理人运用计划财产投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控

	<p>事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产委托人的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响委托财产的投资收益。</p>	<p>制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，以及中国证监会、基金业协会规定的其他重大关联交易情形。重大关联交易以外的关联交易为一般关联交易。本计划将投资于资产管理人管理的公募基金，或资产管理人关联方所设立的中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品。</p> <p>资产管理人将严格按照公司内部关联交易评估机制和审批机制履行相应关联交易评估、审批程序。</p> <p>资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事前文已经明确列明的一般关联交易情形，资产管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得资产委托人的单独、逐笔授权，资产委托人应当充分知悉上述安排并承担相关风险。</p> <p>同时，提示资产委托人注意，虽然资产管理人积极遵循资产委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人运用委托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产委托人的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。</p> <p>此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响委托财产的投资收益。</p> <p>2) 在因重大关联交易征求委托人意见的程序中，委托人持有份额被强制退出或默认其继续持有份额可能导致的相关风险</p> <p>根据本合同的约定，当本计划拟从事重大关联交易时，资产管理人将按约定方式征询资产委托人的意见。如果资产委托人不同意且逾期</p>
--	--	--

13

		<p>未申请退出的，则资产管理人有权在征询意见函中说明的意见回复期届满后将其持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划（退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值），由此发生的相关税费、或有损失由该资产委托人自行承担。即在前述情况下，资产委托人存在被强制退出的风险，从而可能失去本计划后续净值增长带来的亏损修复或分享计划收益的机会，因此请资产委托人届时准确明确回复是否同意重大关联交易的意见，若不同意则请主动退出本计划；资产委托人在征询意见函规定期限内未回复意见且逾期未退出的，视同该资产委托人同意，资产管理人不再另行通知；资产委托人回复意见不明确的，则资产管理人有权视为该资产委托人不同意，按照资产委托人不同意的方式处理。因此，资产委托人可能因为未能及时查阅届时披露信息或未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知资产管理人，而无法及时获知该等重大关联交易事项或者获知了该等重大关联交易事项但未能及时回复意见或未能及时退出本计划，将被视为已经默认同意该等重大关联交易事项，从而与资产委托人届时实际意愿不符，因此请资产委托人及时关注届时本计划相关披露信息并及时回复意见并决定是否退出本计划。</p>
报送要求简化	根据最新监管备案要求，据实修订合同中备案描述。	

经与托管人中国光大银行股份有限公司深圳分行协商一致，同意对合同条款做以上变更。以上调整自 **2023 年 6 月 17 日**起生效。投资者如需了解详细的产

品信息, 请通过本公司官网或销售机构网站查阅本资产管理计划更新后的资产管理合同文件。

风险提示: 本资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本计划资产, 但不保证本计划一定盈利, 也不保证最低收益。请投资者投资本计划前认真阅读本计划的资产管理合同和投资说明书, 并根据自身风险承受能力进行投资。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

摩根士丹利基金管理(中国)有限公司

二〇二三年六月十六日



