

# 摩根基金管理(中国)有限公司

## 关于旗下基金中基金可投资于公开募集基础设施证券投资基金并修订基金合同和托管协议的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第2号-基金中基金指引》(以下简称“《基金中基金指引》”)、《公开募集基础设施证券投资基金指引(试行)》(以下简称“《公募REITs指引》”)等法律法规及相关基金基金合同约定,经与各基金托管人协商一致,摩根基金管理(中国)有限公司(以下简称“基金管理人”)就旗下部分基金中基金可参与公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募REITs”)投资事宜修订基金合同等法律文件,现将有关修订内容说明如下:

### 一、本次修订的基金范围

本次修订涉及基金管理人旗下2只公募基金中基金,相关基金的名单如下:

| 序号 | 基金名称                                |
|----|-------------------------------------|
| 1  | 摩根颐颐养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF) |
| 2  | 摩根双季鑫6个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)         |

### 二、基金合同和托管协议修订内容

基金合同和托管协议修订内容包括明确投资范围包含公募REITs、增加公募REITs的投资策略等。

#### 1、基金合同具体修订内容包括:

(1)“投资范围”部分明确了“基金”包含公开募集基础设施证券投资基金,以摩根双季鑫6个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)为例,具体修改为:“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金(含QDII基金、香港互认基金、公开募集基础设施证券投资基金(公募REITs)及其他经中国证监会核准或注册的基金)、国内依法发行或上市的股票、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、公开发行的次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。”

(2)“投资策略”部分增加公募REITs投资策略:“本基金可投资公募REITs,本基金将综合考虑宏观经济运行情况、基金资产配置策略、底层资产运营情况、流动性及估值水平等因素,对公募REITs的投资价值进行深入研究,精选公募REITs进行投资。本基金根据投资策略需要或市场环境变化,可选择将部分基金资产投资于公募REITs,也可以选择投资公募REITs。”

2、托管协议涉及上述内容的条款一并调整。

3、根据《基金中基金指引》、《公募REITs指引》等相关法律法规的规定和基金合同的约定,公募REITs属于经中国证监会依法注册、公开募集的证券投资基金,本次修订涉及的旗下部分基金中基金的投资范围包含“经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金”,可将公募REITs纳入投资范围。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响,并已履行规定程序,符合相关法律法规及基金合同的规定。

#### 三、重要提示

对于本次基金合同修改的内容,托管协议、招募说明书及基金产品资料概要对应内容也随之相应修改。具体修改内容请见登载于本公司网站(am.jpmorgan.com/cn)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csre.gov.cn/fund>)的更新后的基金合同、托管协议、招募说明书及基金产品资料概要。

本次修订内容自2023年9月6日起生效。

投资者可拨打客户服务热线(400-889-4888)或登录本公司网站(am.jpmorgan.com/cn)咨询相关信息。

#### 风险提示:

投资于公开募集基础设施证券投资基金的特有风险,敬请投资者注意:

公募REITs采用“公募基金+基础设施资产支持证券”的产品结构,主要特点如下:一是公募REITs与投资股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征,其基金资产主要投资于基础设施资产支持证券,并持有其全部份额,基金通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权,穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利;二是公募REITs以获取基础设施项目租金、收费等稳定现金流为主要目的;三是公募REITs采取封闭式运作,不开放申购与赎回,在证券交易所上市,场外基金份额持有人需将基金份额转托管至场内才可卖出或申报预受要约。投资公募REITs可能面临以下风险,包括但不限于:

##### (1)基金价格波动风险。

公募REITs大部分资产投资于基础设施项目,具有权益属性,受经济环境、运营管理等因素影响,基础设施项目市场价值及现金流情况可能发生变化,可能引起公募REITs价格波动,甚至存在基础设施项目遭遇极端事件(如地震、台风等)发生较大损失而影响基金价格的风险。

##### (2)基础设施项目运营风险。

公募REITs投资集中度高,收益率很大程度依赖基础设施项目运营情况,基础设施项目

可能因经济环境变化或运营不善等因素影响,导致实际现金流大幅低于测算现金流,存在基金收益率不佳的风险,基础设施项目运营过程中租金、收费等收入的波动也将影响基金收益分配水平的稳定。此外,公募REITs可直接或间接对外借款,存在基础设施项目经营不达预期,基金无法偿还借款的风险。

(3)流动性风险。

公募REITs采取封闭式运作,不开通申购赎回,只能在二级市场交易,由此可能面临交易量不足引起的流动性风险。

(4)集中投资风险。

公募REITs在封闭运作期内集中持有基础设施资产支持证券,取得基础设施项目完全所有权。因此,相较于其他分散化投资的公募基金,公募REITs将受到所投资基础设施项目较大的影响,具有较高的集中投资风险。

(5)基金份额交易价格折溢价风险。

公募REITs基金合同生效后,将根据相关法律法规申请在交易所上市,在每个交易日的交易时间将根据相关交易规则确定交易价格,该交易价格可能受诸多因素影响;此外,公募REITs还将按照相关业务规则、基金合同约定进行估值并披露基金份额净值等信息。由于基金份额交易价格与基金份额净值形成机制以及影响因素不同,存在基金份额交易价格相对于基金份额净值折溢价的风险。

(6)暂停上市或终止上市风险。

公募REITs在上市期间可能因违反法律法规或交易所规则等原因导致停牌,在停牌期间无法交易基金份额。公募REITs运作过程中可能因触发法律法规或交易所规定的终止上市情形而终止上市,导致投资者无法在二级市场交易。

(7)税收等政策调整风险。

公募REITs运作过程中可能涉及基金份额持有人、公募基金、资产支持证券、项目公司等多层面的税负,如果国家税收等政策发生调整,可能影响投资运作与基金收益。

(8)公募REITs相关法律法规和交易所业务规则,可能根据市场情况进行修改,或者制定新的法律法规和业务规则,投资者应当及时予以关注和了解。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

摩根基金管理(中国)有限公司

2023年9月6日