

## 摩根亚洲总收益债券基金 2020 年 4 月基金说明书之 2020 年 5 月补充文件

下文为摩根亚洲总收益债券基金之 2020 年 4 月基金说明书（“基金说明书”）之组成部分，并应参照基金说明书一并阅读。除非另有指明，否则本补充文件内使用的术语应与基金说明书所载者具有相同的含义。

以下修订适用于基金说明书，即时生效：

### “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、赎回的规则”一节内第(2)项“申购份额的计算”内，就申购份额的计算公式中的“相应份额类别的份额净值”，补充注释如下：

*“<sup>^</sup> 鉴于极端市场状况，财务费用暂时性地适用于本基金。即，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。为了保障所有份额持有人的利益，在计算份额净值时，管理人可能对份额净值作出有关调整，反映预期财务费用之金额，以应付相关成本。该等财务费用并不会超过本基金有关类别份额净值的 1%，并且将会由本基金保留。鉴于极端市场状况，在采用稳健的管理人内部治理流程和方法后，适用于本基金的财务费用的最高费率可暂时性地超过本基金有关类别份额净值的 1%。”*

- “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、赎回的规则”一节内第(3)项“赎回金额的计算”内，就总赎回金额的计算公式中的“相应份额类别的份额净值”，补充注释如下：

*“<sup>^</sup> 鉴于极端市场状况，财务费用暂时性地适用于本基金。即，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。为了保障所有份额持有人的利益，在计算份额净值时，管理人可能对份额净值作出有关调整，反映预期财务费用之金额，以应付相关成本。该等财务费用并不会超过本基金有关类别份额净值的 1%，并且将会由本基金保留。鉴于极端市场状况，在采用稳健的管理人内部治理流程和方法后，适用于本基金的财务费用的最高费率可暂时性地超过本基金有关类别份额净值的 1%。”*

- “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”插入以下内容作为第 3 点：

#### “3. 财务费用

*鉴于极端市场状况，财务费用暂时性地适用于本基金。*

*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。在该等情况下，投资者申购或赎回本基金的份额时的价格未必能准确地反映本基金为应付该等交易要求而买卖相关证券所引致的成本。为了保障所有份额持有人的利益，在计算份额净值时，管理人可能对份额净值作出有关调整，反映预期财务费用之金额，以应付相关成本。该等财务费用并不会超过本基金有关类别份额净值的 1%，并且将会由本基金保留。*

*鉴于极端市场状况，在采用稳健的管理人内部治理流程和方法后，适用于本基金的财务费用的最高费率可暂时性地超过本基金有关类别份额净值的 1%。”*

### “第二章 本基金的基本规定”之“第 A 节 - 摩根亚洲总收益债券基金基金说明书”之修订

- “申购”一节内“份额之发行”分节的最后一段全部删除，并以下文替代：

*“管理人将保留申购费拨归其所有或使用。管理人亦可就申购份额加收财务费用，有关费用将会反映于份额净值内。有关本基金的财务费用政策详情，请参阅下文‘收费、开支及责任’一节内‘财务费用’分节。”*

- “申购”一节内“申请手续”分节倒数第二段最后一句话全部删除，并以下文替代：

“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之日与份额被注销之日之份额净值之差额（如适用，财务费用可反映于份额净值内），以及任何适用之申购费及赎回费。”

- “赎回”一节内“份额之赎回”分节的最后一段全部删除，并以下文替代：

“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。管理人亦可就赎回份额扣除财务费用，有关费用将会反映于份额净值内。有关本基金的财务费用政策详情，请参阅下文‘收费、开支及责任’一节内‘财务费用’分节。”

- 于“收费、开支及责任”一节内“受托人费用”分节后插入以下内容作为新的分节：

#### **“财务费用**

鉴于极端市场状况，财务费用暂时性地适用于本基金。

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可能对现有份额持有人的利益有潜在影响。在该等情况下，投资者申购或赎回本基金的份额时的价格未必能准确地反映本基金为应付该等交易要求而买卖相关证券所引致的成本。为了保障所有份额持有人的利益，在计算份额净值时，管理人可能对份额净值作出有关调整，反映预期财务费用之金额，以应付相关成本。

该等财务费用并不会超过本基金有关类别份额净值的1%，并且将会由本基金保留。

鉴于极端市场状况，在采用稳健的管理人内部治理流程和方法后，适用于本基金的财务费用的最高费率可暂时性地超过本基金有关类别份额净值的1%。”

- “一般资料”一节内“流动性风险管理”分节全部删除，并以下文替代：

“管理人已制订流动性风险管理政策，令其能够识别、监察及管理本基金的流动性风险，并在任何时候均采取适当审慎措施及技巧，以勤勉尽责的态度对其管理的本基金的流动性进行管理，以确保投资者得到公平对待，及在整个产品周期内，本基金的交易安排均适合其各自的投资策略及相关资产。

已建立流动性风险管理的总体框架及独立于日常投资组合投资团队的流动性风险管理流程，以便每日监察流动性风险管理政策及程序的实施。亦已设立多个委员会，对特殊情况进行监督并启动流动性风险管理工具及措施（如适用及经咨询受托人后）。重大流动性风险事件及问题将进一步交予地方或全球委员会／论坛及董事会处理。已确定多种流动性风险管理工具，可应本基金或策略的具体要求调整及使用有关工具。该等工具（包括但不限于公平估值、财务费用及暂停赎回）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。

管理人持续开展流动性风险监控及压力测试，以评估本基金的资产和负债的流动性状况以及是否拥有充足的流动性风险管理工具。将按照不同的流动性级别对基金持仓进行分类，当中计及个别证券的流动性特征及较高级别资产类别的市场深度限制。管理人将在正常及受压市场情景下评估资产和负债的流动性，并密切监察客户的集中持仓情况。

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、财务费用及暂停赎回），请参阅本基金说明书第二章第A节内的‘估值基准’一节、‘收费、开支及责任’一节之‘财务费用’分节以及‘赎回’一节之‘暂停赎回’分节。”