

重要資料：務請即時細閱本重要函件。如閣下對本函件的内容有任何疑問，應尋求獨立專業意見。

除非另有指明，否則本函件內使用的術語應與摩根基金（單位信託系列）內的基金（各稱及統稱「**基金**」）的銷售文件所載者具有相同的涵義。

敬啟者：

摩根基金（單位信託系列）

此函旨在告知閣下有關基金的若干變更。

1. 變更摩根歐洲市場策略股息基金的名稱以及投資目標及政策

為更好地捕捉投資機會及反映基金的貨幣管理慣例，經理人在檢視摩根歐洲市場策略股息基金後，已決定對基金的名稱以及投資目標及政策作出如下變更，由2025年10月31日（包括該日在內）（「**生效日期**」）起生效：

| | 於生效日期前 | 由生效日期起 |
|--------|---|---|
| 基金名稱 | 摩根歐洲市場策略股息基金 | 摩根歐洲股票高息基金 |
| 投資目標 | 基金的投資目標為透過投資其總資產淨值至少70%於以歐洲為基地、在當地交易所上市或主要在當地經營，並預期會派發股息之公司之股票證券，以期提供收益及長期資本增長。 | 基金的投資目標為透過投資其總資產淨值至少70%於以歐洲為基地、在當地交易所上市或主要在當地經營，並預期會派發股息之公司之股票證券，並在適當情況下使用衍生工具，以期提供收益及長期資本增長。 |
| 投資政策摘錄 | 該等股票證券由其管理層表示有意在未來向股東派息的公司所發行。在決定該等股票證券時通常考慮（但不限於）以下因素：上市公司公告和有關股息政策方面之公司訪問、現金流分析和過往記錄。基金可為尋求收益而不時在特定行業或國家擁有重大持倉。 | 該等股票證券由其管理層表示有意在未來向股東派息的公司所發行。在決定該等股票證券時通常考慮（但不限於）以下因素：上市公司公告和有關股息政策方面之公司訪問、現金流分析和過往記錄。基金可為尋求收益而不時在特定行業或國家擁有重大持倉。 |

| | | |
|--|---|--|
| | <p>基金在任何行業可投資的總資產淨值的比例不受任何限制，其可投資的公司市值亦不受任何限制。</p> <p>基金可投資其總資產淨值最多30%於預期派息的歐洲股票證券以外之股票證券。</p> <p>基金可投資其總資產淨值最多10%於債務證券。</p> <p>基金亦可為投資目的而投資於衍生工具，例如期權、認股權證及期貨，並在經理人及投資經理人認為合適之有限情況下（例如為現金管理目的），將其總資產淨值最多100%暫時持有現金及以現金為本的工具。</p> | <p>此外，基金將透過出售在交易所上市或在場外交易（即非上市）的與基金的股票投資組合高度相關的歐洲指數的價外認購期權產生額外收入，並尋求從相關期權金中提供每月收入流。認購期權一般為在到期時以現金結算及大約於一個月屆滿的歐式期權。</p> <p>基金在任何行業可投資的總資產淨值的比例不受任何限制，其可投資的公司市值亦不受任何限制。</p> <p>基金可投資其總資產淨值最多30%於預期派息的歐洲股票證券以外之股票證券。</p> <p>基金可投資其總資產淨值最多10%於債務證券。</p> <p>基金可投資於以其基本貨幣（即歐元）以外的貨幣計價的資產。非歐元貨幣風險可能會被對沖。</p> <p>基金亦可為投資目的而投資於衍生工具，例如期權、認股權證及期貨，並在經理人及投資經理人認為合適之有限情況下（例如為現金管理目的），將其總資產淨值最多100%暫時持有現金及以現金為本的工具。</p> |
|--|---|--|

鑑於上述變更，基金可能承受額外／更高的投資風險，包括以下各項風險：

- 衍生工具風險－與衍生工具相關的風險包括交易對象／信貸風險、流通性風險、估值風險、波動風險及場外交易風險。衍生工具的槓桿元素／成分可能導致虧損大幅高於基金投資於衍生工具的金額。投資於衍生工具可能導致基金蒙受大幅虧損的高風險。

當出售指數認購期權時，基金會獲得現金期權金，但基金從相關工具的市值上升中受惠的機會局限於當該等工具達到期權行使價時該等工具的市值（另加所獲得的期權金）。在大市上升時，當抵押品的價值跌至低於所須的維持保證金時，可能發生基金被追繳保證金的情況。在此情況下，基金將被要求提供額外現金抵押品並可能需要出售所持有的證券以籌措現金，與直接持有證券相比，這可能限制其上升潛力。另一方面，在大市下跌時，基金將繼續承受其股票投資組合的市值降低的風險，及虧損可能超逾基金所獲得的現金期權金。此外，由於認購期權的參考資產與基金的股票投資組合並不完全相同，其風險取向亦不盡相同，導致出現其表現走勢不完全相關的錯配情況（即基差風險）。視乎市況，其相

關性會隨著時間而波動。為符合保證金要求，基金可能需要變現並非與期權直接相關的資產。此項錯配可能加劇虧損風險，特別是當該等資產之間的相關性減弱時。

基金的現有類別將由生效日期起更名如下：

| 現時名稱 | 由生效日期起的經修改名稱 |
|-------------------------------|-----------------------------|
| 摩根歐洲市場策略股息（澳元對沖） （每月派息）類別 | 摩根歐洲股票高息（澳元對沖） （每月派息）類別 |
| 摩根歐洲市場策略股息（歐元） （每月派息）類別 | 摩根歐洲股票高息（歐元） （每月派息）類別 |
| 摩根歐洲市場策略股息（港元對沖） （每月派息）類別 | 摩根歐洲股票高息（港元對沖） （每月派息）類別 |
| 摩根歐洲市場策略股息（人民幣對沖） （每月派息）類別 | 摩根歐洲股票高息（人民幣對沖） （每月派息）類別 |
| 摩根歐洲市場策略股息（美元對沖） （每月派息）類別 | 摩根歐洲股票高息（美元對沖） （每月派息）類別 |

基金的信託契約將由生效日期起作出相應修訂，以反映基金名稱的變更。

經理人認為，由於變更後基金的整體風險取向將不會有重大改變或增加，上述變更並不構成基金的重大變更，及變更不會對投資者的權利或利益造成任何重大不利影響。

與上文所述變更相關的法律及其他行政成本估計約為23,100美元，將由基金承擔。

如鑑於上述變更，閣下希望贖回所持摩根歐洲市場策略股息基金之單位或將其轉換至任何由摩根基金（亞洲）有限公司管理或作為香港代表¹，並獲證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）認可售予香港公眾之其他基金，閣下可按照最新的基金銷售文件所載之買賣手續，由2025年9月25日起至2025年10月30日之豁免期內免費進行²。在轉換至該等基金前，投資者應閱讀及了解相關香港銷售文件所載適用於該等基金的投資目標、政策、風險因素、費用及其他資料。該等基金之詳細資料（包括相關銷售文件）於本公司網頁am.jpmorgan.com/hk³可供索閱。證監會的認可並不代表其對基金的推介或認許，亦不保證基金之商業利弊或其表現。證監會的認可不表示基金適合所有投資者或認許基金適合任何個別投資者或投資者類別。

2. 就轉換申請修訂信託契約

經理人可酌情決定接納或拒絕單位持有人的單位轉換申請。

基金的信託契約將作出修訂，以澄清經理人可接納或拒絕全部或部分轉換申請。

¹ 謹請留意，誠如基金的相關銷售文件所訂明，各有關基金的經理人或香港代表（取適用者）可酌情決定接納或拒絕基金單位或股份（視情況而定）的全部或部分認購申請。

² 謹請留意，儘管我們並不對閣下的贖回／轉換指示收取任何費用，但閣下之銀行、分銷商或財務顧問或會向閣下收取贖回／轉換及／或交易費，以及實施不同的交易安排。如閣下有任何疑問，應聯絡閣下之銀行、分銷商或財務顧問。

³ 此網頁並未經證監會審閱。

3. 就摩根貨幣基金—港元發行多個類別及重新命名現有類別

現時，摩根貨幣基金—港元（「投資組合」）只有一個已發行單位類別。由2025年10月31日起，摩根貨幣基金的信託契約將作出修訂，以納入可就投資組合設立多個類別的靈活性，並進行相關的後續修訂。

投資組合的現有單位將於2025年10月31日重新命名為「摩根貨幣基金—港元（港元）（累計）」。除名稱變更外，投資組合的現有單位的特點並無改變。

基金的銷售文件將作出修訂，以反映上文所述。

4. 其他一般更新

基金的銷售文件及信託契約將作出其他加強披露及雜項修訂，包括：

- 加強風險披露；
- 更新稅務附註；及
- 其他一般及雜項更新。

閣下可於一般辦公時間內於摩根基金（亞洲）有限公司之註冊辦事處⁴免費查閱各基金的信託契約。閣下可於一般辦公時間內於摩根基金（亞洲）有限公司之註冊辦事處⁴，以及瀏覽本公司網頁am.jpmorgan.com/hk³免費索取基金的銷售文件（將以一份補充文件的方式作出修改以反映本函件所述變更）。反映上述修訂的基金的經修訂信託契約將於相關生效日期或之後提供。

基金的經理人就本函件內容之準確性承擔責任。

如閣下對本函件的內容或基金任何其他方面有任何疑問，請聯絡：

- 閣下的銀行或財務顧問；
- 閣下指定的客戶顧問、客戶經理、退休金計劃受託人或行政管理人；或
- 如閣下通常直接與我們聯絡，請致電摩根基金理財專線 (852) 2265 1188。

摩根基金（亞洲）有限公司



董事
陳俊祺
謹啟

2025年9月25日

⁴ 摩根基金（亞洲）有限公司之註冊辦事處位於香港中環干諾道中8號遮打大廈19樓。