

摩根證券投資信託股份有限公司 公告

日期：中華民國112年6月17日

文號：摩信(112)發字第 238號

主旨：本公司經理之「摩根新興市場非投資等級債券證券投資信託基金」(以下簡稱「摩根新興市場非投資等級債券基金」或「消滅基金」)與「摩根亞洲總合非投資等級債券證券投資信託基金」(以下簡稱「摩根亞洲總合非投資等級債券基金」或「存續基金」)之合併事宜。

公告事項：

- 一、 本基金合併案業經金融監督管理委員會中華民國(下同)112年6月15日金管證投字第1120345510號函核准辦理。
- 二、 存續基金名稱：摩根亞洲總合非投資等級債券基金
- 三、 存續基金經理人：周佑倫
- 四、 存續基金之投資策略：摩根亞洲總合非投資等級債券基金主要鎖定亞洲非投資等級債券的投資機會，並將善用集團研究資源，研判景氣趨勢，進行資產配置。基金經理人亦將隨時留意景氣變化與利率走勢，動態掌握各類債券之投資機會，透過對總體經濟的宏觀看法，選擇在不同經濟環境及景氣循環下，對較具相對優勢的債券標的，積極管理影響債券價格走勢的「利率」、「信用」及「匯率」等三大因素為投資目標。存續基金投資亞洲國家或機構所保證或發行、註冊或掛牌之債券總額不得低於存續基金淨資產價值之百分之六十，因此將首選經濟改革成功且快速發展之亞洲國家，並鎖定債信評等提升且具潛力之債券(含非投資等級債券)為主。
- 五、 消滅基金名稱：摩根新興市場非投資等級債券基金
- 六、 合併目的及預期效益：

(一) 合併目的

摩根新興市場非投資等級債券基金與摩根亞洲總合非投資等級債券基金皆屬於海外債券型基金，考量摩根新興市場非投資等級債券基金之基金規模縮減，基於操作成本、效率及受益人權益等因素，期望透過兩檔基金之合併，使基金淨資產價值達一定經濟規模，並提升基金操作效率與彈性，為全體受益人創造更佳的操作績效。

(二) 預期效益

1. 提升基金資產管理效率：透過基金合併，整合相同性質之產品線，以期有效提高基金資產管理效率。
2. 提升基金操作之穩定性：基金合併後，基金淨資產價值規模增加，基金經理人較不易因受益人申購及贖回交易影響，有利於提升基金穩定性，進而提升產品競爭力。

七、 **合併基準日：112年9月22日**

八、 消滅基金最後交易申請日(最後交易日)：112年9月20日

自112年9月21日起不再受理消滅基金之交易(包含申購、買回及轉申購)。

九、 消滅基金換發存續基金受益權單位之計算公式：

受益人原持有消滅基金各計價類型受益權單位數×各計價類型受益權單位合併換發比率。

各計價類型受益權單位合併換發比率=(消滅基金各計價類型受益權單位合併基準日淨資產價值÷消滅基金各計價類型受益權單位合併基準日受益權單位數)÷存續基金各計價類型受益權單位合併基準日單位淨值

各計價類型	「摩根新興市場非投資等級債券基金」換發「摩根亞洲總合非投資等級債券基金」受益權單位之計算公式
	原持有「摩根新興市場非投資等級債券基金-累積型(新臺幣)」受益

累積型新臺幣計價受益權單位	$\text{權單位數} \times \text{累積型(新臺幣)合併換發比率} = \text{可換發「摩根亞洲總合非投資等級債券基金-累積型(新臺幣)」受益權單位數}$
	$\text{累積型(新臺幣)合併換發比率} = \left(\text{「摩根新興市場非投資等級債券基金-累積型(新臺幣)」合併基準日淨資產價值} \div \text{「摩根新興市場非投資等級債券基金-累積型(新臺幣)」合併基準日受益權單位數} \right) \div \text{「摩根亞洲總合非投資等級債券基金-累積型(新臺幣)」合併基準日單位淨值}$
月配息型新臺幣計價受益權單位	$\text{原持有「摩根新興市場非投資等級債券基金月配息型(新臺幣)」受益權單位數} \times \text{月配息型(新臺幣)合併換發比率} = \text{可換發「摩根亞洲總合非投資等級債券基金-月配息型(新臺幣)」受益權單位數}$
	$\text{月配息型(新臺幣)合併換發比率} = \left(\text{「摩根新興市場非投資等級債券基金-月配息型(新臺幣)」合併基準日淨資產價值} \div \text{「摩根新興市場非投資等級債券基金-月配息型(新臺幣)」合併基準日受益權單位數} \right) \div \text{「摩根亞洲總合非投資等級債券基金-月配息型(新臺幣)」合併基準日單位淨值}$
月配息型美元計價受益權單位	$\text{原持有「摩根新興市場非投資等級債券基金月配息型(美元)」受益權單位數} \times \text{月配息型(美元)合併換發比率} = \text{可換發「摩根亞洲總合非投資等級債券基金-月配息型(美元)」受益權單位數}$
	$\text{月配息型(美元)合併換發比率} = \left(\text{「摩根新興市場非投資等級債券基金-月配息型(美元)」合併基準日淨資產價值} \div \text{「摩根新興市場非投資等級債券基金-月配息型(美元)」合併基準日受益權單位數} \right) \div \text{「摩根亞洲總合非投資等級債券基金-月配息型(美元)」合併基準日單位淨值}$
月配息型人民幣計價受益權單位	$\text{原持有「摩根新興市場非投資等級債券基金月配息型(人民幣)」受益權單位數} \times \text{月配息型(人民幣)合併換發比率} = \text{可換發「摩根亞洲總合非投資等級債券基金-月配息型(人民幣)」受益權單位數}$
	$\text{月配息型(人民幣)合併換發比率} = \left(\text{「摩根新興市場非投資等級債券基金-月配息型(人民幣)」合併基準日淨資產價值} \div \text{「摩根新興市場非投資等級債券基金-月配息型(人民幣)」合併基準日受益權單位數} \right) \div \text{「摩根亞洲總合非投資等級債券基金-月配息型(人民幣)」合併基準日單位淨值}$

	投資等級債券基金-月配息型(人民幣)「合併基準日受益權單位數」÷ 「摩根亞洲總合非投資等級債券基金-月配息型(人民幣)」合併基準 日單位淨值
--	--

* 實際之合併換發比率以合併基準日淨資產價值計算之，其所換發受益權單位數不足一單位者，新臺幣計價受益權單位數，以四捨五入之方式計算至小數點以下第一位；外幣計價受益權單位數，以四捨五入之方式計算至小數點以下第二位。

十、消滅基金與存續基金之差異比較

	摩根新興市場非投資等級債券基金 (消滅基金)	摩根亞洲總合非投資等級債券基金 (存續基金)
成立日期	100年4月27日	100年9月29日
保管銀行	中國信託商業銀行股份有限公司	中國信託商業銀行股份有限公司
受託管理機構	摩根資產管理(英國)有限公司 (JPMorgan Asset Management UK Limited)	無
國外投資顧問公司	無	摩根資產管理(亞太)有限公司 JPMorgan Asset Management (Asia Pacific) Limited
投資特色	本基金為掌握新興市場債券未來成長方向，將投資以新興市場美元計價主權債券為主，並視市場狀況輔以投資新興市場企業債與新興市場本地貨幣計價債券，另本基金投資於非投資等級債券之總額，將不低於基金淨資產價值之百分之六十，本基金藉由投資各種新興市場債券，掌握新興市場債券評等提升，	本基金為掌握亞洲未來經濟成長潛力，將投資以美元計價、本地貨幣計價之亞洲國家或企業發行公司債、類主權債券，以及亞洲主權債，另本基金投資於非投資等級債券之總額，將不低於基金淨資產價值之百分之六十，本基金將藉由投資亞洲各種債券，掌握亞洲債券信用評等調升，亞洲

	以創造投資報酬及收益率。本基金投資組合將投資各新興市場債券之信用評等、外匯存底及經濟成長上具有穩定成長潛力之標的，以掌握中長期新興市場債券的獲利機會。	貨幣升值潛力，以創造投資報酬及收益率。本基金投資組合將考量亞洲各國及公司債券之信用評等、財務體質、獲利能力及產業展望具有穩定成長潛力，且以投資符合主管機關所訂非投資等級債券規範之標的為主，以掌握亞洲債券收益及貨幣升值的獲利機會。
基金種類	債券型基金	債券型基金
風險等級	RR4	RR4
基金規模*	4.51 億	11.99 億
經理費	1.35%	1.5%
保管費	0.26%	0.23%

*截至 112 年 4 月 28 日

十一、原持有「摩根新興市場非投資等級債券基金」之受益人若無意於合併基準日轉換至「摩根亞洲總合非投資等級債券基金」，得於本公告日起至最後交易日 112 年 9 月 20 日下午 4 點前提出買回申請或轉申購本公司所經理之其他投信系列基金，並免收轉申購費用。

未於前述期間提出買回或轉申購本公司其他投信系列基金之受益人，則原持有「摩根新興市場非投資等級債券基金」各計價類型受益權單位數將依合併換發比率全數轉換為「摩根亞洲總合非投資等級債券基金」各計價類型受益權單位數。

十二、有辦理「扣款日自由選」投資「摩根新興市場非投資等級債券基金」且仍正常扣款之投資人，若無意轉扣款「摩根亞洲總合非投資等級債券基金」，請於 112 年 9 月 20 日前向本公司提出終止扣款申請；未提

出申請者，將於兩檔基金合併完成後，由系統自動為投資人變更改以扣款「摩根亞洲總合非投資等級債券基金」。

- 十三、原以定期(不)定額投資「摩根新興市場非投資等級債券基金」之受益人若無意轉扣款「摩根亞洲總合非投資等級債券基金」，請於 112 年 9 月 20 日前向本公司提出終止扣款申請；未提出申請者，將於合併基準日後自動轉扣款「摩根亞洲總合非投資等級債券基金」。
- 十四、因本次基金合併，原申請靈活智投(定期轉換停利設定)並約定轉出或轉入至「摩根新興市場非投資等級債券基金」之投資人，自最後交易日之次日(即 112 年 9 月 21 日)起該約定轉換將自動失效。
- 十五、消滅基金「摩根新興市場非投資等級債券基金」因基金合併作業將自 112 年 8 月 23 日起至 112 年 9 月 22 日啟動投資限制特殊情形，不受消滅基金信託契約第 14 條第 1 項第 3 款投資比例限制，該段期間經理公司之報酬將減半計收（即按消滅基金各計價類別受益權單位淨資產價值每年 0.675% 之比率，逐日累計計算）。
- 十六、換發新受益憑證期間：消滅基金與存續基金均採無實體發行，不印製實體受益憑證。本公司將依據「受益憑證事務處理規則」及有價證券集中保管帳簿劃撥作業辦法及證券集中保管事業之相關規定辦理後續受益憑證劃撥轉換事宜。
- 十七、受益人如需索取「摩根亞洲總合非投資等級債券基金」之公開說明書，可逕至公開資訊觀測站(<https://mops.twse.com.tw>)及摩根資產管理官方網站(<https://am.jpmorgan.com/tw>)查詢。
- 十八、特此公告。