摩根證券投資信託股份有限公司 地址:台北市松智路1號20樓

電話:02-8726-8686

摩根證券投資信託股份有限公司 公告

日期:中華民國111年6月6日

字號:摩信(111)發字第 249 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(原名稱:摩根新興市場高收益債券證券投資信託基金」及「摩根亞洲總合非投資等級債券證券投資信託基金(原名稱:摩根亞洲總合高收益債券證券投資信託基金)」(下合稱本基金)修正證券投資信託契約(下稱信託契約)暨公開說明書相關內容,業經金融監督管理委員會(下稱金管會)核准,特此公告。

公告事項:

- 一、 依據金管會中華民國(下同)111 年 6 月 1 日金管證投字第 1110341341 號函 辦理。
- 二、 另依金管會 103 年 3 月 4 日金管證投字第 1030006568 號函規定,本基金修正信託契約第 14 條「運用本基金投資證券及從事證券相關商品交易之基本方針及範圍」條文內容,增訂由金融機構所發行具損失吸收能力之債券為可投資標的,謹訂 111 年 7 月 25 日為施行基準日。
- 三、本次修正事項業經基金保管機構同意,並經金管會核准在案,信託契約之 修正條文對照表如後附;另本基金公開說明書配合修正,修正後之公開說 明書可於公開資訊觀測站(http://mops.twse.com.tw) 及本公司官方網站 (https://am.jpmorgan.com/tw)查詢。

摩根證券投資信託股份有限公司 地址:台北市松智路1號20樓

電話: 02-8726-8686

摩根新興市場非投資等級債券證券投資信託基金證券投資信託契約修正條文對照表

	修訂後條文		現行條文	說明
第十四條	運用本基金投資證券及從事證	第十四條	運用本基金投資證券及從事	
	券相關商品交易之基本方針及		證券相關商品交易之基本方針	
	範圍		及範圍	
第一項	由外國國家或機構所保證或發	第一項	由外國國家或機構所保證或	依據證券投資信託
第二款	行之债券(含政府公债、公司	第二款	發行之債券(含政府公債、公	基金管理辦法(以
第一目	债、可轉換公司债、附認股權	第一目	司債、可轉換公司債、附認股	下稱「基金管理辨
	公司債、無擔保公司債及交換		權公司債、無擔保公司債及交	法」)第27條第1項
	公司債、金融債券、金融資產		換公司債、金融債券、金融資	規定,明訂由金融
	證券化之受益證券或資產基礎		產證券化之受益證券或資產基	機構發行具損失吸收能力之債券(含
	證券、不動產資產信託受益證		礎證券、不動產資產信託受益	應急可轉換債券
	券、由金融機構發行具損失吸		證券、符合美國Rule 144A規	(Contingent
	收能力之債券(含應急可轉換		定之债券及具有相當於债券性	Convertible Bond,
	<u>債券(Contingent Convertible</u>		質之有價證券)。	CoCo Bond)及具總
	Bond, CoCo Bond)及具總損失			損失吸收能力
	吸收能力(Total Loss-			(Total Loss-
	Absorbing Capacity, TLAC)債			Absorbing Capacity,
	<u>券)</u> 、符合美國Rule 144A規定			TLAC)債券為可投 資標的。
	之債券及具有相當於債券性質			() () () () () () () () () ()
	之有價證券)。			
第八項	不得投資於股票、具股權性質	第八項	不得投資於股票、具股權性	依據基金管理辦法
第一款	之有價證券及結構式利率商品	第一款	質之有價證券及結構式利率商	第27條第2項規定
	;但正向浮動利率債券、轉換		品;但正向浮動利率債券、轉	,明訂由金融機構
	公司債、附認股權公司債、交		換公司債、附認股權公司債及	發行具損失吸收能
	換公司債及由金融機構發行具		交換公司債不在此限,且投資	力之债券為可投資
	損失吸收能力之債券不在此限		轉換公司債、附認股權公司債	標的,並將原投資 比例限制規定移至
	; 前開轉換公司債、附認股權		及交換公司債總金額不得超過	本條項第8款。
	公司债及交換公司债於條件成		基金淨資產價值之百分之十;	1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1
	就致轉換、認購或交換為股票		前開轉換公司債、附認股權公	
	者,應於一年內調整至符合規		司债及交换公司债於條件成就	
	定;		致轉換、認購或交換為股票者	
			,應於一年內調整至符合規定	
			;	

摩根證券投資信託股份有限公司 地址:台北市松智路1號20樓

電話: 02-8726-8686

修訂後條文		現行條文		說明
第八項	投資於轉換公司債、附認股權		(新增)	將原第1款投資比
第八款	公司債、交換公司債及符合金			例限制規定移列,
	融主管機關所定合格資本工具			並依基金管理辦法
	之具損失吸收能力之債券(如			第27條第2項明訂
	應急可轉換債券(Contingent			投資符合金融主管
	Convertible Bond, CoCo			機關所定合格資本
	Bond))之總金額不得超過本基			工具之具損失吸收
	金淨資產價值之百分之十;			能力之债券之投資
				比例限制。
第八項	投資於應急可轉換債券		(新增)	依據金管證投字第
第九款	(Contingent Convertible			11003656489 號函
	Bond, CoCo Bond)之總金額,			,明訂應急可轉換
	不得超過本基金淨資產價值之			債券 (Contingent
	百分之十;投資於具總損失吸			Convertible Bond, CoCo Bond)及具總
	收能力(Total Loss-Absorbing			損失吸收能力
	Capacity, TLAC)債券之總金額			(Total Loss-
	,不得超過本基金淨資產價值			Absorbing Capacity,
	之百分之十;前開債券應符合			TLAC)債券之投資
	經金管會核准或認可之信用評			上限及應符合信評
	等機構評等達一定等級以上;			規定。
第八項	投資於任一銀行所發行之金融	第八項	投資於任一銀行所發行之金	明訂具損失吸收能
第十 <u>三</u> 款	債券 (含次順位金融債券、具	第十 <u>一</u> 款	融債券 (含次順位金融債券)	力之債券(如應急
	損失吸收能力之債券(如應急		之總金額,不得超過本基金淨	可轉換債券
	可轉換債券(Contingent		資產價值之百分之十,及該銀	Contingent
	Convertible Bond, CoCo		行所發行金融債券總額之百分	Convertible Bond,
	Bond)及具總損失吸收能力		之十;投資於任一銀行所發行	CoCo Bond 及具總 損失吸收能力Total
	(Total Loss-Absorbing		次順位金融債券之總額,不得	有关级收配力Total Loss-Absorbing
	Capacity, TLAC)債券)) 之總		超過該銀行該次(如有分券指	Capacity, TLAC)債券
	金額,不得超過本基金淨資產		分券後)所發行次順位金融債	亦屬本款投資之金
	價值之百分之十,及該銀行所		券總額之百分之十;	融債券比率限制範
	發行金融債券總額之百分之十			
	;投資於任一銀行所發行次順			
	位金融债券之總額,不得超過			
	該銀行該次(如有分券指分券			
	吸收11吸入 (>1) 有刀分相刀分			



摩根證券投資信託股份有限公司 地址:台北市松智路1號20樓

電話:02-8726-8686

修訂後條文		現行條文		說明
	後)所發行次順位金融債券總			
	額之百分之十;			
第十項	第八項第(八)款至第(十八)款	第十項	第八項第(一)款、第(八)款	配合引用款次調整
	、第(<u>二十</u>)款至第(<u>二十三</u>)款		至第(十六)款、第(十八)款至	酌修部分文字。
	規定比例、金額及期限之限制		第(二十一)款規定比例、金額	
	,如因有關法令或相關規定修		及期限之限制,如因有關法令	
	正者,從其規定。		或相關規定修正者,從其規定	
			0	

摩根亞洲總合非投資等級債券證券投資信託基金證券投資信託契約修正條文對照表

	修訂後條文		現行條文	說明
第十四條	運用本基金投資證券及從事證	第十四條	運用本基金投資證券及從事	
	券相關商品交易之基本方針及		證券相關商品交易之基本方針	
	範圍		及範圍	
第一項	本基金投資於外國之有價證券	第一項	本基金投資於外國之有價證	依據證券投資信託
第二款	為由外國國家或機構所保證或	第二款	券為由外國國家或機構所保證	基金管理辦法(以
	發行之債券(含政府公債、公		或發行之債券(含政府公債、	下稱「基金管理辦
	司債、金融債券、金融資產證		公司債、金融債券、金融資產	法」)第27條第1項
	券化之受益證券或資產基礎證		證券化之受益證券或資產基礎	規定,明訂由金融
	券、不動產資產信託受益證券		證券、不動產資產信託受益證	機構發行具損失吸收能力之債券(含
	、由金融機構發行具損失吸收		券、符合美國Rule 144A規定	應急可轉換債券
	能力之債券(含應急可轉換債券		之债券及具有相當於債券性質	(Contingent
	(Contingent Convertible Bond,		之有價證券),並應符合金管	Convertible Bond,
	CoCo Bond)及具總損失吸收能		會之禁止或限制規定。本基金	CoCo Bond)及具總
	カ (Total Loss-Absorbing		所投資之債券,不包括以國內	損失吸收能力
	Capacity, TLAC)債券)及符合美		有價證券、本國上市、上櫃公	(Total Loss-
	國Rule 144A規定之債券及具有		司於海外發行之有價證券、國	Absorbing Capacity,
	相當於債券性質之有價證券)		內證券投資信託事業於海外發	TLAC)債券為可投
	, 並應符合金管會之禁止或限		行之基金受益憑證、未經金管	資標的。
	制規定。本基金所投資之債券		會核准或申報生效得募集及銷	
	,不包括以國內有價證券、本		售之境外基金為連結標的之連	
	國上市、上櫃公司於海外發行		動型或結構型債券。	

資產管理

摩根證券投資信託股份有限公司 地址:台北市松智路1號20樓

電話:02-8726-8686

	修訂後條文		現行條文	說明
第第八一款	之有價券と 一方 一方 一方 一方 一方 一方 一方 一方 一方 一方	第第第第十八一	現行條文 現行條文 不得投資的債務。 不得投資的人工。 一次有關, 有關, 有關, 有關, 有關, 有關, 有關, 有關, 有關, 有關,	說明 · 就明 · 就明 · 依據第27條第1項金灣第一項 要類 表 表 表 表 表 表 表 表 表 表 表 表 表 表 表 表 表 表
第八項	Convertible Bond, CoCo Bond)及具總損失吸收能力(TotalLoss-AbsorbingCapacity,TLAC)債券)之總金額,不得	第八項	行所發行金融債券總額之百分 之十;投資於任一銀行所發行 次順位金融債券之總額,不得 超過該銀行該次(如有分券指	CoCo Bond 及具總 損失吸收能力Total Loss-Absorbing Capacity, TLAC)債券
第二十四款	投員於轉換公司債、附認股權公司債、交換公司債及符合金融主管機關所定合格資本工具之具損失吸收能力之債券(如應	第二十四款	投員於轉換公司債、附認股權公司債及交換公司債總金額 ,不得超過本基金淨資產價值 之百分之十。前開 <u>債券</u> 於條件	农基省理辦法第 27條第2項明訂投 資符合金融主管機 關所定合格資本工

資產管理

摩根證券投資信託股份有限公司 地址:台北市松智路1號20樓

電話:02-8726-8686

修訂後條文		現行條文		說明
	急可轉換債券 (Contingent		成就致轉換、認購或交換為股	具之具損失吸收能
	Convertible Bond, CoCo Bond))		票者,應於一年內調整至符合	力之债券之投資比
	總金額,不得超過本基金淨資		規定 <u>。</u>	例限制。另依基金
	產價值之百分之十。前開轉換			管理辦法第27條第
	公司債、附認股權公司債及交			3項,爰修訂後段
	換公司債於條件成就致轉換、			文字。
	認購或交換為股票者,應於一			
	年內調整至符合規定 <u>;</u>			
第八項	投資於應急可轉換債券		(新增)	依據金管證投字第
第二十五	(Contingent Convertible Bond,			11003656489 號 函
<u>款</u>	CoCo Bond)之總金額,不得超			,明訂應急可轉換
	過本基金淨資產價值之百分之			債 券 (Contingent
	十;投資於具總損失吸收能力			Convertible Bond,
	(Total Loss-Absorbing Capacity,			CoCo Bond)及具總
	TLAC)債券之總金額,不得超			損失吸收能力
	過本基金淨資產價值之百分之			(Total Loss- Absorbing Capacity,
	十;前開債券應符合經金管會核			TLAC) 債券之投資
	准或認可之信用評等機構評等			上限及應符合信評
	達一定等級以上。			規定。
第十項	第八項第(八)款至第(十四)款	第十項	第八項第(八)款至第(十四)款	配合引用款次調整
	、第(十六)款至第(十八)款、第		、第(十六)款至第(十八)款、	酌修部分文字。
	(二十二)款、第(二十四)款至第		第(二十二)款及第(二十四)	
	(二十五)款規定比例、金額及		款規定比例、金額及期限之限	
	期限之限制,如因有關法令或		制,如因有關法令或相關規定	
	相關規定修正者,從其規定。		修正者,從其規定。	