

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
关于旗下部分基金增加侧袋机制
并相应修改基金合同、托管协议的公告

根据 2020 年 8 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的要求，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）对旗下 9 只公募基金增加侧袋机制并修订基金合同、托管协议等法律文件。本次修订主要对相应基金的基金合同中释义、基金份额的申购与赎回、基金份额持有人大会、基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配和基金的信息披露等章节的部分条款进行修订，并相应修改了基金的托管协议，同时对相应基金的招募说明书中涉及的相关内容进行相应修订。现将有关事项公告如下：

一、本次修订的基金范围

本次修订涉及基金管理人旗下9只公募基金，详细名单见本公告的附表。

二、基金合同的修订内容

基金合同修改对照表：以摩根士丹利华鑫多元收益债券型证券投资基金基金合同为例

修订前	修订后
二、释义	二、释义 61、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

	<p>62、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；</p> <p>（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p>	<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>（十六）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回</p> <p>本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。</p>
<p>八、基金份额持有人大会</p>	<p>八、基金份额持有人大会</p> <p>（十）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</p> <p>若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：</p> <p>1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；</p>

	<p>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；</p> <p>5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；</p> <p>6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；</p> <p>7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。</p>
--	--

	<p>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。</p>
<p>十二、基金的投资</p>	<p>十二、基金的投资</p> <p>(九) 侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。</p> <p>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</p> <p>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p>
<p>十四、基金资产的估值</p> <p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>3. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性</p>	<p>十四、基金资产的估值</p> <p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>3. 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>(九) 实施侧袋机制期间的基金资产估值</p>

<p>时，基金管理人经与基金托管人协商确认的；</p>	<p>本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。</p>
<p>十五、基金的费用与税收</p>	<p>十五、基金的费用与税收</p> <p>（六）实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。</p>
<p>十六、基金的收益与分配</p>	<p>十六、基金的收益与分配</p> <p>（六）实施侧袋机制期间的收益分配</p> <p>本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。</p>
<p>十八、基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息包括：</p>	<p>十八、基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息包括：</p> <p>（十一）实施侧袋机制期间的信息披露</p> <p>本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。</p>

注：以上修订内容仅为示例，不同基金的基金合同中相应条款表述及修订位置可能存在差异，具体请以相关基金披露的修订后的法律文件内容为准。

三、基金管理人经与相关基金托管人协商一致，在本公司对相关基金的基金合同进行修订后，对相关基金的托管协议、招募说明书（更新）中涉及的上述相关内容进行相应修订，在招募说明书中补充侧袋机制相关章节，并增加启用侧袋机制的风险揭示内容。同时，根据实际情况更新法律文件中的部分基金托管人信息，在基金产品资料概要中补充基金合同的争议解决方式。本次对基金合同、托管协议、基金招募说明书（更新）的修订属于因相应的法律法规发生变动而应当进行的修改，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就本次修改法律文件事宜履行了规定程序，符合法律法规和监管机构的规定及基金合同的约定。

四、本次相关基金修订后的基金合同、托管协议自2021年6月30日起生效。修改后的相关法律文件全文将与本公告同日登载于基金管理人网站（www.msfunfs.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。投资者可登录本公司网站查询或拨打本公司客户服务热线：400-8888-668 咨询有关详情。

五、重要提示

侧袋机制实施期间，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，基金份额持有人可能面临无法及时获得侧袋账户对应部分的资金的流动性风险。

启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间及最终变现价格均具有不确定性，并且变现价格有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅考虑主袋账户资产，因此相关基金披露的业绩指标不能反映特定资产的价值

及变化情况。实施侧袋机制期间，因相关基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

风险提示：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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资者应认真阅读拟投资基金的《基金合同》、招募说明书、产品资料概要等法律文件，了解所投资基金的风险收益特征，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2021年6月30日

附表：本次修订基金合同、托管协议的相关基金名单

序号	基金名称
1	摩根士丹利华鑫强收益债券型证券投资基金
2	摩根士丹利华鑫灵动优选债券型证券投资基金
3	摩根士丹利华鑫纯债稳定增值18个月定期开放债券型证券投资基金
4	摩根士丹利华鑫纯债稳定增利18个月定期开放债券型证券投资基金
5	摩根士丹利华鑫纯债稳定添利18个月定期开放债券型证券投资基金
6	摩根士丹利华鑫优质信价纯债债券型证券投资基金
7	摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金
8	摩根士丹利华鑫多元收益债券型证券投资基金
9	摩根士丹利华鑫丰裕63个月定期开放债券型证券投资基金