

摩根

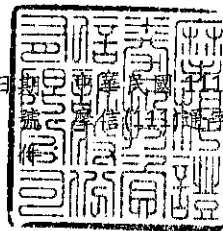
資產管理

J.P.Morgan

ASSET MANAGEMENT

函

發文日期：中華民國111年6月9日
文號：摩信(111)通字第250號
附件



受文者：各銷售機構(如附件一)

主旨：為通知 貴公司有關本公司經理之「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)第 14 條暨公開說明書相關內容，敬請 查照。

說明：

- 一、本公司依據金融監督管理委員會(下稱金管會)中華民國(下同)111年6月1日金管證投字第 1110341341 號函辦理(如附件二)。
- 二、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，請於修正事項施行前 30 日公告及通知受益人。
- 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附件三；另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。
- 四、如有任何疑問，請電詢：(02)8726-8686。

摩根證券投資信託股份有限公司

董事長 唐德瑜



附件一

中國信託商業銀行股份有限公司
國泰世華商業銀行股份有限公司
華南商業銀行股份有限公司
臺灣中小企業銀行股份有限公司
合作金庫商業銀行股份有限公司
日盛國際商業銀行股份有限公司
玉山商業銀行股份有限公司
第一商業銀行股份有限公司
兆豐國際商業銀行股份有限公司
彰化商業銀行股份有限公司
台新國際商業銀行股份有限公司
上海商業儲蓄銀行股份有限公司
永豐商業銀行股份有限公司(理財商品部)
臺灣土地銀行股份有限公司
陽信商業銀行股份有限公司
京城商業銀行股份有限公司
高雄銀行股份有限公司
聯邦商業銀行股份有限公司
安泰商業銀行股份有限公司
板信商業銀行股份有限公司
元大商業銀行股份有限公司
臺灣新光商業銀行股份有限公司
台中商業銀行股份有限公司
華泰商業銀行股份有限公司
三信商業銀行股份有限公司
臺灣銀行股份有限公司
凱基商業銀行股份有限公司
台北富邦商業銀行股份有限公司
遠東國際商業銀行股份有限公司
星展(台灣)商業銀行股份有限公司
渣打國際商業銀行股份有限公司
匯豐(台灣)商業銀行股份有限公司
花旗(台灣)商業銀行股份有限公司
法商法國巴黎銀行股份有限公司台北分公司

凱基證券股份有限公司
群益金鼎證券股份有限公司
永豐金證券股份有限公司
元大證券股份有限公司
元富證券股份有限公司
日盛證券股份有限公司
華南永昌綜合證券股份有限公司
基富通證券股份有限公司
國泰綜合證券股份有限公司
富邦綜合證券股份有限公司
鉅亨證券投資顧問股份有限公司
中租證券投資顧問股份有限公司
中國人壽保險股份有限公司
台灣人壽保險股份有限公司
全球人壽保險股份有限公司
宏泰人壽保險股份有限公司
保誠人壽保險股份有限公司
國泰人壽保險股份有限公司
第一金人壽保險股份有限公司
安聯人壽保險股份有限公司
富邦人壽保險股份有限公司
新光人壽保險股份有限公司
法商法國巴黎人壽保險股份有限公司台灣分公司
南山人壽保險股份有限公司
台銀人壽保險股份有限公司
合作金庫人壽保險股份有限公司
英屬百慕達商安達人壽保險股份有限公司台灣分公司
國際康健人壽保險股份有限公司

正本

檔 號：

保存年限：

金融監督管理委員會 函

地址：22041新北市板橋區縣民大道2段7號18樓

承辦人：許淑芬

電話：02-27747153

傳真：02-87734154

電子信箱：fany0125@sfb.gov.tw

受文者：摩根證券投資信託股份有限公司(代表人唐德瑜先生)

發文日期：中華民國111年6月1日

發文字號：金管證投字第1110341341號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如文

主旨：所報修正貴公司經理之「摩根新興市場非投資等級債券證券投資信託基金」及「摩根亞洲總合非投資等級債券證券投資信託基金」信託契約第14條條文及公開說明書一案，同意照辦，並請依說明事項辦理，請查照。

說明：

- 一、依據本會證券期貨局案陳貴公司111年4月26日摩信(111)發字第190號函辦理。
- 二、請依本會103年3月4日金管證投字第1030006568號函，於證券投資信託契約修正內容施行前30日，公告及通知受益人。
- 三、請將旨揭基金修正後之信託契約，依證券投資信託基金管理辦法第78條規定於2日內辦理公告。
- 四、請依證券投資信託事業募集證券投資信託基金公開說明書應行記載事項準則第25條及本會93年11月11日金管證四字第0930005499號令規定，於本會同意函送達之日起3日內將修正後公開說明書傳送至公開資訊觀測站。
- 五、檢附同意修正之旨揭基金證券投資信託契約條文如附件。

正本：摩根證券投資信託股份有限公司(代表人唐德瑜先生)

副本：中國信託商業銀行股份有限公司(代表人利明猷先生)、中華民國證券投資信託暨
顧問商業同業公會(代表人張錫先生)

主任委員 **黃天牧**

授權單位主管決行並鈐印

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

修訂後條文		現行條文		說明
第八項 第八款	投資於轉換公司債、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(如應急可轉換債券(Contingent Convertible Bond, CoCo Bond))之總金額不得超過本基金淨資產價值之百分之十；		(新增)	將原第1款投資比例限制規定移列，並依基金管理辦法第27條第2項明訂投資符合金融主管機關所定合格資本工具之具損失吸收能力之債券之投資比例限制。
第八項 第九款	投資於應急可轉換債券(Contingent Convertible Bond, CoCo Bond)之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十；投資於具總損失吸收能力(Total Loss-Absorbing Capacity, TLAC)債券之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十；前開債券應符合經金管會核准或認可之信用評等機構評等達一定等級以上；		(新增)	依據金管證投字第11003656489號函，明訂應急可轉換債券(Contingent Convertible Bond, CoCo Bond)及具總損失吸收能力(Total Loss-Absorbing Capacity, TLAC)債券之投資上限及應符合信評規定。
第八項 第十三款	投資於任一銀行所發行之金融債券(含次順位金融債券、具損失吸收能力之債券(如應急可轉換債券(Contingent Convertible Bond, CoCo Bond)及具總損失吸收能力(Total Loss-Absorbing Capacity, TLAC)債券))之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，及該銀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(如有分券指分券	第八項 第十一款	投資於任一銀行所發行之金融債券(含次順位金融債券)之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，及該銀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(如有分券指分券後)所發行次順位金融債券總額之百分之十；	明訂具損失吸收能力之債券(如應急可轉換債券Contingent Convertible Bond, CoCo Bond)及具總損失吸收能力Total Loss-Absorbing Capacity, TLAC)債券亦屬本款投資之金融債券比率限制範疇。

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(二十)款至第(二十三)款規定比例、金額及期限之限制，如因有關法令或相關規定修正者，從其規定。	第十項	第八項第(一)款、第(八)款至第(十六)款、第(十八)款至第(二十一)款規定比例、金額及期限之限制，如因有關法令或相關規定修正者，從其規定。	配合引用款次調整酌修部分文字。

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

修訂後條文		現行條文		說明
	之有價證券、國內證券投資信託事業於海外發行之基金受益憑證、未經金管會核准或申報生效得募集及銷售之境外基金為連結標的之連動型或結構型債券。			
第八項第一款	不得投資於轉換公司債、附認股權公司債、交換公司債及由金融機構發行具損失吸收能力之債券以外之其他具股權性質之有價證券及股票或證券投資信託基金受益憑證、除投資正向浮動利率債券外，不得投資於結構式利率商品；	第八項第一款	不得投資於轉換公司債、附認股權公司債及交換公司債以外之其他具股權性質之有價證券及股票或證券投資信託基金受益憑證、除投資正向浮動利率債券外，不得投資於結構式利率商品；	依據基金管理办法第27條第1項規定，增訂本基金得投資由金融機構發行具損失吸收能力之債券。
第八項第十一款	投資於任一銀行所發行之金融債券(含次順位金融債券、具損失吸收能力之債券(如應急可轉換債券(Contingent Convertible Bond, CoCo Bond)及具總損失吸收能力(Total Loss-Absorbing Capacity, TLAC)債券))之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，及該銀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(如有分券指分券後)所發行次順位金融債券總額之百分之十；	第八項第十一款	投資於任一銀行所發行之金融債券(含次順位金融債券)之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十，及該銀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(如有分券指分券後)所發行次順位金融債券總額之百分之十；	明訂具損失吸收能力之債券(如應急可轉換債券Contingent Convertible Bond, CoCo Bond及具總損失吸收能力Total Loss-Absorbing Capacity, TLAC)債券亦屬本款投資之金融債券比率限制範疇。
第八項第二十四款	投資於轉換公司債、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	第八項第二十四款	投資於轉換公司債、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。前開債券於條件	依基金管理办法第27條第2項明訂投資符合金融主管機關所定合格資本工

修訂後條文		現行條文		說明
	<u>急可轉換債券 (Contingent Convertible Bond, CoCo Bond)</u> 總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十。前開 <u>轉換公司債、附認股權公司債及交換公司債</u> 於條件成就致轉換、認購或交換為股票者，應於一年內調整至符合規定；		成就致轉換、認購或交換為股票者，應於一年內調整至符合規定。	具之具損失吸收能力之債券之投資比例限制。另依基金管理辦法第27條第3項，爰修訂後段文字。
第八項 第二十五款	投資於 <u>應急可轉換債券 (Contingent Convertible Bond, CoCo Bond)</u> 之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十；投資於具總損失吸收能力 (Total Loss-Absorbing Capacity, TLAC) 債券之總金額，不得超過本基金淨資產價值之百分之十；前開債券應符合經金管會核准或認可之信用評等機構評等達一定等級以上。		.(新增)	依據金管證投字第11003656489號函，明訂應急可轉換債券 (Contingent Convertible Bond, CoCo Bond) 及具總損失吸收能力 (Total Loss-Absorbing Capacity, TLAC) 債券之投資上限及應符合信評規定。
第十項	第八項第(八)款至第(十四)款、第(十六)款至第(十八)款、第(二十二)款、第(二十四)款至第(二十五)款規定比例、金額及期限之限制，如因有關法令或相關規定修正者，從其規定。	第十項	第八項第(八)款至第(十四)款、第(十六)款至第(十八)款、第(二十二)款及第(二十四)款規定比例、金額及期限之限制，如因有關法令或相關規定修正者，從其規定。	配合引用款次調整酌修部分文字。