

# 信息披露 Disclosure

## 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告

根据中国证监会(证监基金字[2006]93号)《关于证券投资基金管理费支付证券有关事项的通知》的规定和摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(以下简称“本公司”)所管理基金的基金合同,本公司旗下基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券,现将本公司旗下基金投资资产支持证券投资方案公告如下:

一、适用范围  
本公司旗下所有的投资于资产支持证券的证券投资基金,包括本公司公告后成立的可投资于资产支持证券的证券投资基金。

二、投资策略  
本基金投资资产支持证券将结合基金产品特征和投资策略、资产支持证券的基本风险收益特征、具体资产支持证券的交易结构、资产池资产状况、信用增级情况、信用评级情况等信息的基础上,做出相应的投资计划。本公司旗下基金将通过定期的信用风险分析与跟踪、量化模型评估、投资限制控制等方法对资产支持证券进行有效的风险评估和控制,并在有效控制风险的基础上提高组合收益。

三、投资限制  
本公司旗下所有基金投资资产支持证券,除法律法规、基金合同另有规定外,将遵循下述投资限制:

1、投资比例限制  
1)单只开放式投资基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%。

2)单只开放式投资基金持有的同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的10%。

3)本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券规模合计数的10%。

4)单只开放式投资基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的20%,中国证监会规定的特殊品种除外。

5)因市场波动、基金规模变动等基金经理人之外的因素致使证券投资基金投资资产支持证券不符合上述第2项和第4项规定比例的,基金经理人将在10个交易日内调整完毕。

6)货币市场基金可投资于剩余期限在397天以内(含397天)的货币市场工具,浮动利率资产支持证券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。债券基金、股票基金、混合基金等其他类别的证券投资基金投资于资产支持证券的期限,依照中国证监会相关规定及基金合同中的约定执行。

2、信用等级限制

1)本公司旗下基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。

2)货币市场基金投资的资产支持证券的信用评级,应不低于业内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的信用级别。

3)货币市场基金以外的其他类别的证券投资基金投资于资产支持证券,应遵守基金合同规定的证券信用级别的限制,若基金合同未订明对应的证券信用级别限制,应投资于信用级别评级为BB以上(BBB)的资产支持证券。

4)本公司旗下基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降,不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

四、风险揭示

资产支持证券虽然是国际上一种成熟的证券产品,但在国内市场发展初期可能具有低流动性、高收益的特征,并存在一定的投资风险。本公司所管理的部分证券投资基金将投资资产支持证券,基金份额持有人注意投资风险。本公司本着谨慎和控制风险的原则投资资产支持证券,但仍面临以下风险:

1、信用风险  
若所投资的资产支持证券之债务人出现违约,或在交易过程中发生交收违约,或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,可能造成基金财产损失。

2、利率风险  
市场利率波动会导资产支持证券的收益率和价格的变动,一般而言,如果市场利率上升,基金持有资产支持证券面临价格下降、本金损失的风险,而如果市场利率下降,资产支持证券利息的再投资收益面临下降的风险。

3、流动性风险  
资产支持证券受券场规模及交易活跃程度的影响,资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出,存在一定的流动性风险。

4、提前偿付风险  
债务人有可能由于利率变化等原因进行提前偿付,从而使基金资产面临再投资风险。

5、法律风险  
由于法律法规方面的原因,某些市场行为受到限制或合同不能正常执行,导致基金财产的损失。

6、风险控制措施  
鉴于投资资产支持证券可能面临的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等,本公司将通过谨慎和风险可控的原则,制定相应的产品管理制度,通过充分的研究支持、信用分析、投资授权控制等方法对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制,同时,本公司对资产支持证券投资业务实行严格的风险监控,通过事前控制、事中监控和事后风险评估及报告等措施,保障资产支持证券投资的合规合规。

六、信息披露方式  
本公司依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》和基金合同,招募说明书及其他有关规定的要求,在基金法定信息披露文件中及时、充分地披露该基金投资资产支持证券的相关信息。

本公司将在基金年度报告及中期报告中披露所持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例如表和报告期内按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

七、相关提示  
本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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》等法律文件,了解拟投资基金的风险收益特征,并根据自身情况购买与风险承受能力相匹配的产品。

特此公告。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

二〇一九年十月二十四日

## 关于调整鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金管理费和托管费并修改基金合同及托管协议等事项的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,决定降低本基金的管理费和托管费,并相应修改基金合同和其他法律文件相关内容。具体修改内容如下:

一、修改内容要点:  
1、调整基金管理人的管理费  
本基金的基金管理费费率拟由1.00%调至0.60%。

2、调整基金管理人的托管费  
本基金的基金托管费费率拟由0.25%调至0.10%。

二、《鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订对照表

基金合同条款		修改前内容	修改后内容
1. 基金管理人与管理费		1. 基金管理人的管理费 本基金的基金管理费率为每日基金净资产值的0.60%。管理费计算方法如下: H=Ex1.00%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。  2. 基金托管人的管理费 本基金的托管费率拟由每日基金净资产值的0.25%的年费率降低至0.10%。托管费的计算方法如下:  H=Ex0.10%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。	1. 基金管理人的管理费 本基金的基金管理费率为每日基金净资产值的0.60%。管理费计算方法如下: H=Ex1.00%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。  2. 基金托管人的管理费 本基金的托管费率拟由每日基金净资产值的0.25%的年费率降低至0.10%。托管费的计算方法如下:  H=Ex0.10%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。
2. 基金管理人与托管费		本基金的托管费率拟由每日基金净资产值的0.25%的年费率降低至0.10%。托管费的计算方法如下:  H=Ex0.10%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。  3. 基金管理人与管理费 本基金的管理费费率拟由每日基金净资产值的0.60%的年费率降低至0.40%。管理费的计算方法如下:  H=Ex0.40%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。  4. 基金管理人与托管费 本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。  5. 其他费用 本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。托管费的计算方法如下:  H=Ex0.10%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。  6. 其他费用 本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
二十四部分“基金合同条款”、“四、(二)费用计提方法,计提及支付方式”		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。托管费的计算方法如下:  H=Ex0.10%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。托管费的计算方法如下:  H=Ex0.10%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。

三、《鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订对照表

条款名称		修改前内容	修改后内容
(一)基金管理费的计提比例和计提方法		1)基金管理费的计提比例 基金管理费计提比例为每日基金净资产值的0.60%。管理费计算方法如下: H=Ex1.00%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。  2)基金管理费的计提方法 本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。  3)基金管理费的计提比例和计提方法 本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	1)基金管理费的计提比例 基金管理费计提比例为每日基金净资产值的0.60%。管理费计算方法如下: H=Ex1.00%×当日基金 H为每日计提的基金管理费 E为基金的净资产值 基金管理人每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金管理人复核后于次月月初3个工作日内从基金管理人一次性支付给基金管理人。  2)基金管理费的计提方法 本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。  3)基金管理费的计提比例和计提方法 本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二)基金托管费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(四)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(五)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(六)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(七)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(八)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(九)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十一)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十二)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十三)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十四)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十五)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十六)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十七)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十八)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(十九)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十一)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十二)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十三)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十四)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十五)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十六)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十七)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十八)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(二十九)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十一)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十二)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十三)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十四)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十五)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十六)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十七)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十八)基金管理费的计提比例和计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(三十九)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(四十)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(四十一)基金管理费的计提方法		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。
(四十二)基金管理费的计提比例		本基金的托管费率拟由0.25%降低至0.10%。	