

# 中國信託證券投資信託股份有限公司 函



地址：臺北市南港區經貿二路188號12樓

聯絡人：薛竹軒

電話：02-26526688#6507

傳真：02-27891339

受文者：安達國際人壽保險股份有限公司

發文日期：中華民國115年5月20日

發文字號：中信(投信)字第11505253002 號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如說明

主旨：謹通知貴我雙方簽訂之全權委託投資契約「安達人壽全權委託中國信託投信代操大師策略管理投資帳戶-累積」、「安達人壽全權委託中國信託投信代操大師策略管理投資帳戶-月撥回(現金)」及「安達人壽全權委託中國信託投信代操大師策略管理投資帳戶-月撥回」(下合稱本投資帳戶)變更投資策略及子基金清單異動，詳如說明，請查照。

說明：

- 一、依據貴我雙方於民國(下同)111年6月29日簽訂之全權委託投資契約及其附件三約定辦理。
- 二、本公司為強化且更即時反應市場變化，調整本投資帳戶投資策略如下；且為實際投資及管理需求，擬異動本投資帳戶原契約約定之可投資子基金清單，並已與貴公司完成全委投資契約之契約增補事宜，新投資策略及可投資子基金清單將自115年6月1日起生效。

(一)調整Shiller指數

1. 美國指數：Shiller Barclays CAPE US Core Mid-Month ETF Sector Net Index
2. 歐洲指數：Shiller Barclays CAPE Europe Sector Net TR NoC USD Index

## (二)國家/區域配置

每月根據OECD美國綜合領先指標(USA OECD Leading Indicators CLI Normalised SA)與OECD歐洲前4大國家綜合領先指標(4 Big European OECD Leading Indicators CLI Normalised SA)之最新數據及市場價格面因子經量化計算後，判斷美國與歐洲的景氣訊號為正常或嚴峻並決定配置比例，原則上美國：歐洲比例為100%：0%。

## (三)標的選擇

每月再根據美國與歐洲Shiller「CAPE® Ratio」選出評價最低的五個產業，再由其中根據報酬動能強度選出前四檔產業標的，作為該月投資組合標的，建構該月之投資組合。

## (四)風險控制

每日監控恐慌指數(美國VIX，歐洲V2X)量化計算之各自風險控制指標，判斷是否為高波動訊號來降低帳戶下檔風險。

## (五)異動後之子基金清單

提供異動後之子基金清單(詳附件)，據以更新本帳戶原契約附錄一。

正本：安達國際人壽保險股份有限公司  
副本：花旗（台灣）商業銀行股份有限公司

中國信託證券投資信託股份有限公司



附件：可投資之子基金列表

原契約【附錄：可投資之子基金列表】

序號	類型	Bloomberg ticker	ISIN code	投資標的
1	股票	XLU UP	US81369Y8865	State Street Utilities Select Sector SPDR ETF
2	股票	XLP UP	US81369Y3080	State Street Consumer Staples Select Sector SPDR ETF
3	股票	XLF UP	US81369Y6059	State Street Financial Select Sector SPDR ETF
4	股票	XLB UP	US81369Y1001	State Street Materials Select Sector SPDR ETF
5	股票	XLK UP	US81369Y8030	State Street Technology Select Sector SPDR ETF
6	股票	XLV UP	US81369Y2090	State Street Health Care Select Sector SPDR ETF
7	股票	XLE UP	US81369Y5069	State Street Energy Select Sector SPDR ETF
8	股票	XLY UP	US81369Y4070	State Street Consumer Discretionary Select Sector SPDR ETF
9	股票	XLI UP	US81369Y7040	State Street Industrial Select Sector SPDR ETF
10	股票	XLC UP	US81369Y8527	State Street Communication Services Select Sector SPDR ETF
11	股票	IYR UP	US4642877397	iShares U.S. Real Estate ETF
12	股票	VPU UP	US92204A8760	VANGUARD UTILITIES ETF
13	股票	VDC UP	US92204A2078	Vanguard Consumer Staples ETF
14	股票	VFH UP	US92204A4058	VANGUARD FINANCIALS ETF
15	股票	VAW UP	US92204A8018	VANGUARD MATERIALS ETF
16	股票	VGT UP	US92204A7028	Vanguard Information Technology ETF
17	股票	VHT UP	US92204A5048	VANGUARD HEALTH CARE ETF
18	股票	VDE UP	US92204A3068	VANGUARD ENERGY ETF
19	股票	VCR UP	US92204A1088	Vanguard Consumer Discretionary ETF
20	股票	VIS UP	US92204A6038	VANGUARD INDUSTRIALS ETF
21	股票	VNQ UP	US9229085538	Vanguard Real Estate ETF
22	股票	STU FP	IE00BKWQ0P07	SS SPDR MSCI Europe Utilities UCITS ETF
23	股票	STS FP	IE00BKWQ0D84	SS SPDR MSCI Europe Consumer Staples UCITS ETF
24	股票	STZ FP	IE00BKWQ0G16	SS SPDR MSCI Europe Financials UCITS ETF
25	股票	STP FP	IE00BKWQ0L68	SS SPDR MSCI Europe Materials UCITS ETF
26	股票	STK FP	IE00BKWQ0K51	SS SPDR MSCI Europe Technology UCITS ETF
27	股票	STW FP	IE00BKWQ0H23	SS SPDR MSCI Europe Health Care UCITS ETF
28	股票	STN FP	IE00BKWQ0F09	SS SPDR MSCI Europe Energy UCITS ETF
29	股票	STR FP	IE00BKWQ0C77	SS SPDR MSCI Europe Consumer Discretionary UCITS ETF
30	股票	STQ FP	IE00BKWQ0J47	SS SPDR MSCI Europe Industrials UCITS ETF
31	股票	STT FP	IE00BKWQ0N82	SS SPDR MSCI Europe Communication Services UCITS ETF
32	債券	SHV UP	US4642886794	iShares 0-1 Year Treasury Bond ETF
33	債券	TIP UP	US4642871762	iShares TIPS Bond ETF
34	債券	SHY UP	US4642874576	iShares 1-3 Year Treasury Bond ETF

序號	類型	Bloomberg ticker	ISIN code	投資標的
35	債券	IEI UP	US4642886612	iShares 3-7 Year Treasury Bond ETF
36	債券	IEF UP	US4642874402	iShares 7-10 Year Treasury Bond ETF
37	債券	TLT UP	US4642874329	iShares 20+ Year Treasury Bond ETF
38	債券	SGOV US	US46436E7186	iShares 0-3 Month Treasury Bond ETF
39	債券	BIL US	US78468R6633	State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill ETF
40	貨幣	PUK3743 LX	LU0012186622	法巴美元貨幣市場基金 C (美元)
41	貨幣	JPUMMAU LX	LU0945454980	摩根基金 根美元浮動淨值貨幣基金 - JPM美元浮動淨值貨幣(美元) - A股(累計)
42	貨幣	MIGSDRI LX	LU0006061419	貝萊德美元儲備基金 A2 美元
43	股票	XLRE UP	US81369Y8600	State Street Real Estate Select Sector SPDR ETF

裝

訂

線