

函

發文日期：中華民國 106 年 1 月 19 日  
文 號：摩信(106)通字第 099 號  
附 件：如 文

受文者：各銷售機構(如附件一)

主 旨：為通知 貴公司關於本公司總代理之「摩根投資基金 - 策略總報酬基金」、「摩根基金-環球策略債券基金」及「摩根基金-新興市場本地貨幣債券基金」(以下合稱本基金)等 3 檔基金申請變更風險值法模型乙事如說明，敬請 查照。

說 明：

- 一、本基金業經專案豁免持有衍生性商品部位限制之基金申請變更風險值法模型一事，業經金融監督管理委員會民國(下同)106 年 1 月 9 日金管證投字第 1050044878 號函核准(如附件二)。
- 二、前述事項，對於本基金之投資目標、投資策略、投資限制及風險屬性並無任何改變，故不會對投資人產生重大影響。敬請 貴公司自即日起再行將前述調整事宜轉知所屬投資人。
- 三、如有任何疑問，請電詢：(02)8726-8755。

摩根證券投資信託股份有限公司

總經理 尤昭文



## 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  
台北富邦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  
大眾商業銀行股份有限公司  
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  
遠東國際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  
星展(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  
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  
瑞興商業銀行股份有限公司  
澳盛(台灣)商業銀行股份有限公司

瑞士商瑞士銀行股份有限公司台北分公司  
法商法國巴黎銀行股份有限公司台北分行  
凱基證券股份有限公司  
富邦綜合證券股份有限公司  
元富證券股份有限公司  
第一金證券股份有限公司  
群益金鼎證券股份有限公司  
統一證券股份有限公司  
元大證券股份有限公司  
日盛證券股份有限公司  
遠智證券股份有限公司  
永豐金證券股份有限公司  
兆豐證券股份有限公司  
國泰綜合證券股份有限公司  
華南永昌綜合證券股份有限公司  
新加坡商瑞銀證券股份有限公司台北分公司  
基富通證券股份有限公司  
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  
朝陽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  
臺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

正本

附件二

經電子交換確認

# 金融監督管理委員會 函

地址：新北市板橋區縣民大道二段7號18樓  
聯絡人：黃小姐  
聯絡電話：02-27747223  
傳真：02-87734154

受文者：摩根證券投資信託股份有限公司【代表人：石恬華】

發文日期：中華民國106年1月9日  
發文字號：金管證投字第1050044878號  
速別：普通件  
密等及解密條件或保密期限：普通  
附件：無

主旨：所請貴公司總代理之「摩根投資基金-策略總報酬基金」、「摩根基金-環球策略債券基金」及「摩根基金-新興市場本地貨幣債券基金」等三檔業經專案豁免持有衍生性商品部位限制之基金申請變更風險值法模型案，准予照辦，請查照。

說明：

- 一、依據本會證券期貨局案陳中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會105年11月1日中信顧字第1050800437號函辦理。
- 二、旨揭申請事項倘有再變更市場風險衡量措施(例如風險值法改為承諾法等)或風險值法之模型或參數設定變更，仍應重新提出專案申請。

正本：摩根證券投資信託股份有限公司【代表人：石恬華】  
副本：中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會

主任委員 李瑞倉

授權單位主管決行並鈐印