

## 得獎及入圍紀錄

## 投資特色

- (一) 追蹤滬深300日報酬正向2倍指數報酬，提高投資效率。
- (二) 基金之槓桿倍數固定，較期貨、選擇權商品易於管理。
- (三) 投資人運用本基金，得免除證券相關商品交易與信用交易之管理。

## 基金簡介

經理人	張克豪	保管費	0.21%
成立日期	2015/05/06	標準差(24個月)	17.32
基金規模	4.87億元	貝他值(24個月)	2.83
基金淨值	8元	夏普值(24個月)	-0.42
保管銀行	玉山商業銀行	風險報酬等級	RR5
經理費	0.99%	適合投資人	積極型

本基金為指數股票型基金(反向型ETF)，主要投資於與滬深300指數相關之有價證券及其他證券相關商品，且以放空期貨為主要交易，本基金具反向操作風險，故依據中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會「基金風險報酬等級分類標準」所訂，本基金風險報酬等級為RR5。(風險報酬等級依基金類型、投資區域或主要投資標的/產業由低至高區分為「RR1、RR2、RR3、RR4、RR5」)惟此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險，不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所有投資本基金之風險，如：價格波動風險、反向操作風險、基金報酬未能緊貼標的指數報酬之風險等。

## 產業 / 投資配置

期貨保證金	現金/RP
40.06%	60.05%

## 前10大RP交易對象

交易對象	%	交易對象	%
台新國際商業銀行股份有限公司	18.46	--	--
兆豐票券金融股份有限公司	16.41	--	--
中華票券金融股份有限公司	10.26	--	--
萬通票券金融股份有限公司	10.26	--	--
台灣票券金融股份有限公司	1.03	--	--

## 累積報酬率(%)

期間	3個月	6個月	1年	2年	3年	5年	今年以來	成立以來
績效	1.14	-16.14	-36.10	-39.07	-44.25	-58.22	1.14	-59.98

(註：累積報酬率係以基金本身計價幣別(即原幣)計算)

**元大投信**

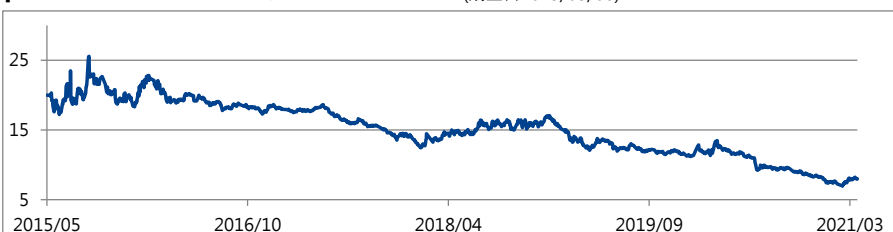
手機掃瞄，理財帶著走

**ETF  
系列**
**基金**


★ 詳閱更多基金內容 ★

## 成立以來基金淨值表現 / 單位：新台幣

(成立日2015/05/06)



以上資料來源：理柏、彭博、元大投信。資料截止日期：2021/03/31。

(本配置為目前本基金之實際布局，未來投資將依公開說明書規範及當時市場環境與經濟現況而調整)

【元大投信獨立經營管理】本基金經金管會同意生效，惟不表示絕無風險。本公司以往之經理績效，不保證本基金之最低投資收益；本公司除盡善良管理人之注意義務外，不負責本基金之盈虧，亦不保證最低之收益，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，基金投資風險請詳閱基金公開說明書。有關基金應負擔之相關費用，已揭露於基金公開說明書中，投資人可向本公司及基金之銷售機構索取，或至公開資訊觀測站及本公司網站(<http://www.yuantafunds.com>)中查詢。基金非存款或保險，故無受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障。大陸地區及新興市場證券之波動度與風險程度可能較高，且其政治與經濟情勢穩定度通常低於已開發國家，可能影響所投資地區之有價證券價格波動，而使資產價值受不同程度影響。基於大陸地區對境外機構投資者(QFII)投資額度管制或有影響基金操作之特定因素，經理公司保留婉拒或暫停受理本基金申購或買回申請之權利。有關本基金之特性(含適格投資人始得交易)、投資人應負擔之成本費用及相關投資風險等資訊，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。**投資人應注意「元大滬深300傘型證券投資信託基金之滬深300單日反向1倍證券投資信託基金」為策略交易型產品，其投資具有反向操作風險，其投資盈虧深受市場波動與複利效果影響，與傳統指數股票型基金不同。投資人應了解該基金所追求之「滬深300日報酬反向一倍指數」(以下稱標的指數)報酬僅限於「單日」操作目的。該基金需依基金資產及市場現況每日計算基金所需曝險額度及重新平衡投資組合，因此基金淨值將受到每日重新平衡後之投資組合價格波動之影響。標的指數係基於滬深300指數的每日收益表現所編製及計算，以反應單日反向1倍的報酬表現。受到計算累積報酬之複利效果影響，標的指數連續兩日以上及長期之累積報酬率會偏離同期間「滬深300指數」之累積報酬，且偏離方向無法預估，故該基金不適合追求長期投資且不熟悉該基金以追求單日報酬為投資目標之投資人，除專業機構投資人之外，限符合臺灣證券交易所訂適格條件之投資人始得交易。投資人交易前，應詳閱基金公開說明書並確定已充分瞭解本基金之風險及特性。該基金上市日前(不含當日)，經理公司不接受基金受益憑證受益權單位之買回。投資人於成立日(不含當日)前參與申購所買入的每受益權單位之發行價格(即新臺幣貳拾元)，不等同於基金掛牌上市之價格，參與申購投資人需自行承擔基金成立日起自掛牌日止期間之基金淨資產價格波動所產生折/溢價的風險。滬深300日報酬反向一倍指數/滬深300指數(以下簡稱指數)由中證指數有限公司(以下簡稱「指數提供者」)編制和計算，其所有權歸屬指數提供者。指數提供者將採取一切必要措施以確保指數的準確性，但不對此作任何保證，亦不因指數的任何錯誤對任何人負責。指數提供者不對指數的實時性、完整性和準確性做出任何承諾，除非因指數提供者故意或重大過失而導致指數計算收盤數據的延遲、缺失、錯誤及其它故障導致指數不符合指數編制方案的要求，亦不對指數內容延遲、缺失、錯誤及其它故障所導致經理公司、本基金或本基金受益人之損失承擔責任。**

台北總公司：106臺北市大安區敦化南路二段67號地下1樓

台中分公司：406台中市崇德路二段46之4號5樓

客服專線0800-009-968-(02)8770-7703