

元大標普高盛原油ER指數股票 型期貨信託基金 (期信ETF，期元大S&P石油 00642U)

本基金為首檔追蹤原油期貨指數的指數股票型期貨信託基金，主要以追蹤標普高盛原油增強超額回報指數之績效表現為目標，提供台灣投資人原油相關波段交易之工具。

基金簡介

經理人	黃議玄	保管費	0.15%
成立日期	2015/08/27	標準差(24個月)	--
基金規模	28.11億元	貝他值(24個月)	--
基金淨值	17.11元	夏普值(24個月)	--
保管銀行	永豐商業銀行	風險報酬等級	高波動度
經理費	1.00%	適合投資人	高波動承受型

風險分類標準

低波動度：三年平均年化波動度未逾10%者。

中波動度：三年平均年化波動度逾10%而未逾30%者。

高波動度：三年平均年化波動度逾30%者。

基金得獎紀錄

◎榮獲亞洲資產管理雜誌評選2015年「最佳新ETF」

◎榮獲2018年BENCHMARK指標雜誌 台灣年度基金大獎 最佳表現ETF大獎-原物料同級最佳獎

資料來源:亞洲資產管理雜誌、BENCHMARK指標雜誌

前10大RP交易對象

持倉契約名稱	持倉價值占 AUM (月平均)	持倉契約名稱	持倉價值占AUM (月平均)
NYMEX 1000桶西德州輕 原油期貨	100.00%		
合計	100.00%		

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	2.52	-4.36	5.88	3.07	62.95	-3.77	9.75	-14.41

(註：累積報酬率係以基金本身計價幣別(即原幣)計算)

成立以來基金淨值表現 / 單位：新台幣 (成立日2015/08/27)



以上資料來源：理柏、公會、元大投信。資料截止日期：2024/02/29。

(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】本期貨信託基金經金融監督管理委員會核准，惟不表示本基金絕無風險。本期貨信託事業以往之經理績效不保證本基金之最低投資收益；本期貨信託事業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。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。期貨信託基金從事之期貨交易具低保證金之財務槓桿特性，在可能產生極大利潤的同時也可能產生極大的損失，致基金受益權單位淨資產價值大幅增減，投資人投資基金前，應審慎考慮本身的財務能力及經濟狀況是否適合於這種投資，並詳讀本公開說明書。本基金自成立日起，即依據標的指數成分契約的權重建構本基金交易部位，基金投資組合成分價格波動會影響基金淨值表現，投資人於本基金掛牌上市前申購所購入的每單位淨資產價值，不等於基金掛牌上市後之價格，於本基金掛牌上市前申購之投資人需自行承擔自申購日起自上市掛牌日止期間之基金價格波動所產生折/溢價的風險。本基金受益憑證上市後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依臺灣證券交易所所有規定辦理。本基金上市日前(不含當日)，經理公司不接受本基金受益權單位之買回。本基金資產將高度集中交易於標的指數成分之原油期貨，故本基金淨資產價值會受到原油期貨價格波動影響，如原油期貨價格下跌將造成本基金淨資產價值之損失，而本基金追求標的指數報酬之目標及操作，不因標的指數劇烈波動而改變。此外，本基金係以交易原油期貨為主，申購人應了解原油期貨價格不等於原油現貨價格，兩者之間可能存在價格差異。本基金投資標的指數之指數成分為單一月份的美國紐約商業交易所(The New York Mercantile Exchange, NYMEX)原油期貨契約，惟所選之原油期貨契約，係依指數編製規則所挑選後之期貨契約，該期貨契約無論於存續性、參與廣泛性、活絡性、代表性等層面上皆屬相對良好的投資標的，雖此可降低單一標的商品之風險，但仍無法完全避免。免責聲明：「標普高盛原油增強超額回報指數」(S&P GSCI Crude Oil Enhanced Excess Return)是 S&P Dow Jones Indices LLC(“SPDJ”)的一款產品，且已授權予元大投信使用。Standard & Poor’s® 與 S&P® 均為 Standard & Poor’s Financial Services LLC(“S&P”)的註冊商標；Dow Jones® 是 Dow Jones Trademark Holdings LLC(“Dow Jones”)的註冊商標；這些商標已授權予SPDJI 使用。S&P®、S&P GSCI® 和標普高盛原油增強超額回報指數是 S&P 的商標，且已授權予 SPDJI 及其附屬公司使用，並已從屬授權予元大投信用於特定用途。Goldman Sachs & Co.或其附屬公司並不擁有、擔保或批准標普高盛原油增強超額回報指數或與其有關聯。SPDJI、Dow Jones、S&P、其各自的附屬公司或其第三方許可人均不保薦、擔保、銷售或推廣元大投信的元大標普高盛原油ER指數股票型期貨信託基金，而且他們中的任何一方概不就投資有關產品的合理性做出任何聲明。

台北總公司：106 台北市大安區敦化南路二段 69 號 18 樓、67 號 B1
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