

元大台灣50單日反向1倍基金

(本基金為策略交易型產品且投資具有槓桿操作風險，故本基金不適合長期持有，僅符合臺灣證券交易所訂適格條件之投資人始得交易)

2024年07月31日

投資特色

(一)追蹤臺灣 50 指數單日反向 1 倍報酬，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	陳威志
成立日期	2014/10/23
基金規模	285.11億元
基金淨值	3.49元
保管銀行	華南商業銀行
經理費	1.00%
保管費	0.04%
標準差(24個月)	18.41
貝他值(24個月)	-0.95
夏普值(24個月)	-0.38
風險報酬等級	RR5
適合投資人	積極型

本基金為指數股票型基金(反向型ETF)，主要投資於國內上市股票及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、基金單日報酬未能緊貼標的指數單日反向1倍報酬之風險等。本基金之投資風險請參閱本公開說明書【基金概況】之「投資風險揭露」所列內容。

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	-10.28	-21.75	-26.06	-39.72	-37.68	-69.44	-22.27	-82.55

(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2014/10/23)



投資組合

產業 / 投資配置

期貨保證金	現金/RP
25.36%	74.66%

前10大RP交易對象

名稱	%
兆豐證券股份有限公司	16.50
台新國際商業銀行股份有限公司	14.03
中華票券金融股份有限公司	8.94
凱基商業銀行股份有限公司	8.42
第一金證券股份有限公司	6.14
全國農業金庫股份有限公司	4.38
元富證券股份有限公司	2.98
大中票券金融股份有限公司	2.77
臺灣土地銀行股份有限公司	1.75
萬通票券金融股份有限公司	1.75

基金得獎紀錄

- ◎榮獲財資雜誌2015年最佳產品創新獎槓桿反向傘型基金
- ◎榮獲亞洲資產管理雜誌評選2015年「最佳槓桿反向ETF」
- ◎榮獲2017年Smart智富台灣基金獎-期貨&槓桿指數型基金獎
- ◎榮獲2018年Smart智富台灣基金獎-指數股票型基金獎(證券類)
- ◎榮獲2019年《第22屆金鑽獎》ETP基金獎指數股票型反向指數
- ◎榮獲2020年Smart智富台灣基金獎-期貨與槓桿指數股票型基金獎

資料來源:財資雜誌、亞洲資產管理雜誌、Smart智富台灣基金獎、台北金融研究發展基金會

以上資料來源：理柏、公會、元大投信。資料截止日期：2024/07/31。

(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)

投資一定有風險，基金投資有賺有賠，申購前應詳閱公開說明書。

本基金為策略交易型產品且投資具有槓桿操作風險，故本基金不適宜長期持有，僅符合臺灣證券交易所訂適格條件之投資人始得交易。

【元大投信獨立經營管理】投信公司製作之廣告文宣均遵守會員及其銷售機構從事廣告及營業活動行為規範，若將廣告文宣再編製作者，應以本公司所公開資料為主，不得為誇大不實之內容且須留意本基金之風險平衡，另避免使用聳動之文字為標題。本基金經金管會核准或同意生效，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。有關基金的運用限制、投資風險及投資人應直接或間接負擔之相關費用、紛爭處理及申訴管道等皆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簡式公開說明書與公開說明書，或至公開資訊觀測站及本公司網站(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。本基金自成立日起，依據追蹤標的指數成分進行基金持續投資組合之佈局，投資組合成分價格波動會影響基金淨值表現，本基金每日基金淨值，由經理公司公告之。本基金係採用指數化策略，以追蹤標的指數之單日反向1倍報酬表現為投資目標，投資人應了解本基金所追求標的指數反向1倍報酬僅限於「單日」操作目的，本基金具有反向風險，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。本基金不適宜追求長期投資且不熟悉本基金以追求單日報酬為投資目標之投資人。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。本基金為達到追求標的指數單日反向1倍報酬之目標，投資組合整體反向曝險部位將盡可能維持在基金淨資產價值100%之水位，故本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。受到計算累積報酬之複利效果影響，本基金連續兩日以上及長期之累積報酬率可能會偏離同期間標的指數反向1倍之累積報酬，且偏離方向無法預估，有關計算累積報酬之複利效果之說明請詳見本基金公開說明書。除「臺灣證券交易所股份有限公司受益憑證買賣辦法」另有規定者外，本基金限符合臺灣證券交易所訂適格條件之投資人始得交易，並應敘明與證券交易所訂定內容相符之風險預告書，經理公司、基金銷售機構或參與證券商始得接受其交易。

本基金所追蹤指數非屬客製化指數，亦非屬Smart Beta指數。指數免責聲明：「元大 ETF 傘型證券投資信託基金之台灣 50 單日反向 1 倍證券投資信託基金」非由富時國際有限公司(「富時集團」)、倫敦證券交易所(「交易所」)、或臺灣證券交易所(「臺灣證交所」)(統稱「許可方」)以任何方式贊助、背書、銷售或宣傳，任何許可方均不對任何日期、任何時間使用富時臺灣證券交易所臺灣 50 指數(一種富時集團/臺灣證交所產品)(「指數」)和/或該「指數」所處的數值導致的結果做出任何明示或隱含保證或陳述。「指數」由臺灣證交所在富時集團的協助下編撰和計算。「指數」中的所有知識財產權均歸富時集團和臺灣證交所所有。任何許可方均不對指數中的任何錯誤對任何人承擔責任(不論是疏忽責任還是其他責任)，也沒有義務向任何人告知其中的任何錯誤。「FTSE®」是倫敦交易所的商標，「TWSE」和「TAIEX」是臺灣證交所的商標，均由富時集團根據授權使用。

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