

元大滬深300單日反向1倍基金

(本基金為策略交易型產品且投資具有反向操作風險，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)

基金簡介

成立日期	2015/05/06	保管銀行	玉山商業銀行
基金規模	3.15億元	基金類型	跨國投資指數股票型_槓桿型/反向型_股票
基金淨值	8.54元	風險報酬等級	RR5
經理費*	0.99%	經理人	張克豪
保管費*	0.21%		

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。

基金得獎紀錄

淨值走勢

(成立日2015/05/06)



投資特色

- (一)追蹤滬深 300 日報酬反向 1 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。

期間	近3月	近6月	近1年	近2年	近3年	近5年	今年以來	成立以來
績效	1.18	4.53	-13.12	-7.68	-7.87	-31.79	1.18	-57.28

(註：累積報酬率係以基金本身計價幣別(即原幣)計算)

前10大RP交易對象

名稱	%
大慶票券金融股份有限公司	15.85
大中票券金融股份有限公司	9.51

基金成分

期貨保證金	現金/RP
63.12%	36.84%

以上資料來源：理柏資訊、投信投顧公會、元大投信。資料截止日期：2025/03/31。

*經理費/保管費按揭示比率逐日累積計算於淨值，不另外收取。有關基金應負擔之費用已揭露於基金之公開說明書中，投資人可至公開資訊觀測站中查詢。

請詳閱末頁警語；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

第1頁/共2頁

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。

【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。元大系列基金經金融監督管理委員會或其指定機構核准或申報生效，惟不表示基金絕無風險。本公司以往之經理績效，不保證系列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，不負責系列基金之盈虧，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。有關基金應負擔之費用已揭露於基金之公開說明書中，投資人可至公開資訊觀測站中查詢。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。元大系列基金的運用限制、投資風險、配息機制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。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本公司網站(www.yuantafunds.com)查詢，亦可至公開資訊觀測站(mopsplus.twse.com.tw)下載公開說明書。

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。本基金不適合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，並應簽具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。

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。

本基金以新臺幣計價，而本基金所投資的有價證券或期貨標的可能為新臺幣以外之計價貨幣，因此本基金承受相關匯率波動風險可能使本基金報酬與投資目標產生偏離。

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：滬深300 日報酬反向一倍指數(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 | 地址：105 台北市松山區敦化南路一段66號1樓、4樓、5樓及68號2樓之1；電話：(02)2717-5555；一百一十三金管投信新字第零壹零號

台中分公司 | 地址：406 台中市北屯區崇德路二段46-4 號5樓；電話：(04)2232-7878；一百一十一金管投信新分字第零零貳號

本公司兼營投顧的核准文號：96年7月30日金管證四字第0960039848號函

客服專線：0800-009-968、(02)8770-7703