元大標普500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	2015/12/02	保管銀行	玉山商業銀行
基金規模	7.89億元	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	4.62元	風險報酬等級	RR5
經理費*	0.99%	經理人	方雅婷
保管費*	0.18%		

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。

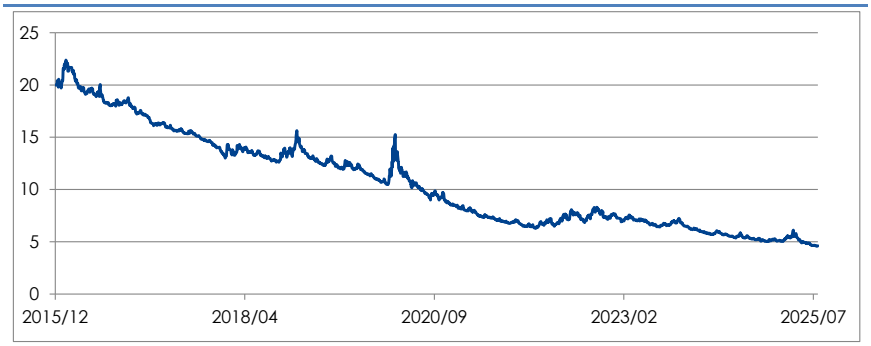
基金得獎紀錄

◎2015年《亞洲資產管理雜誌》最佳新ETF

資料來源：亞洲資產管理雜誌

淨值走勢

(成立日2015/12/02)



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	-13.48	-8.70	-16.15	-28.04	-35.29	-53.29	-11.66	-76.90

(註：累積報酬率係以基金本身計價幣別(即原幣)計算)

投資特色

(一)追蹤標普500反向指數，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。

前10大RP交易對象

名稱	%
大中票券金融股份有限公司	22.81
台新國際商業銀行股份有限公司	19.01
萬通票券金融股份有限公司	10.14
台灣票券金融股份有限公司	8.87

基金成分

期貨保證金	現金/RP
30.37%	69.93%

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：2025/07/31。

*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

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(即「標普500反向指數」)之報酬表現為投資目標，以放空期貨為主要交易，基金具有反向操作風險，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，故不適合追求長期投資且不熟悉本子基金以追求單日報酬為投資目標之投資人。投資人交易前，應詳閱本基金公開說明書並確定已充分瞭解本基金之風險及特性。本基金之標的指數「標普500反向指數」係基於標普500指數的單日報酬所編製及計算，以反應「標普500指數」單日反向 1 倍的報酬表現。「標普500反向指數」之計算因受到累積報酬之複利效果影響，故連續兩日以上及長期之累積報酬率可能會與同期間「標普500指數」之反向 1 倍報酬產生偏離，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。

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。
本基金淨值以新臺幣計價而基金主要投資與標的指數相關之有價證券及證券相關商品，因此匯率波動會影響本基金淨值之計算，而計算盤中估計淨值所使用的盤中即時匯率，因評價時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算之匯率或有差異。此外，臺灣證券交易時間與美國證券交易時間因時差關係無重疊之交易時間，故本基金之交易部位及淨值須於交易後次一營業日確認及計算，因此計算盤中估計淨值與實際基金淨值計算之基金投組或有差異，投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。

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：標普500 反向指數(S&P 500® PR Inverse Carry-Free Daily Index)是 S&P Dow Jones Indices LLC（“SPDJI”）的產品，且已授權予元大投信使用。Standard & Poor’s®、S&P® 與標普 500(S&P 500®）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，並已再授權予元大投信使用於特定用途。SPDJI、Dow Jones Trademark Holdings LLC、S&P 及其各自的附屬公司(統稱“S&P Dow Jones Indices”)均不保薦、擔保、銷售或推廣元大投信的元大標普500單日反向 1 倍基金(以下統稱「基金」)。S&P Dow Jones Indices 概不就一般投資於證券或特定投資於基金是否適合或指數追蹤一般市場表現的能力，對基金的持有人或任何公眾人士作出任何明示或暗示的聲明或保證。就指數而言，S&P Dow Jones Indices 與元大投信的關係僅為授權其使用 S&P Dow Jones Indices 的特定指數、商標、服務標誌及/或商業名稱。指數由 S&P Dow Jones Indices 確定、組成及計算，無需考慮元大投信或基金。S&P Dow Jones Indices 在確定、組成或計算指數時概無義務考慮元大投信或基金的需求。S&P Dow Jones Indices 概不負責且不參與確定基金的發行或銷售時間，亦不負責且不參與確定或計算基金轉換為現金或贖回的相關公式。S&P Dow Jones Indices 就基金的管理、銷售貨交易概不承擔任何義務或法律責任，且概不保證基於指數的投資產品將準確追蹤指數表現或提供正投資回報。S&P Dow Jones Indices LLC 並非投資顧問。將證券納入指數並不代表 S&P Dow Jones Indices 建議購買、出售或持有有關證券，亦不得被視為投資建議。儘管上文已作出規定，CME Group Inc.及其附屬公司仍可獨立發行及/或保薦與元大投信目前正在發行的基金無關，但可能與基金相類似且相競爭的金融產品。此外，CME Group Inc.及其附屬公司還可交易與指數表現掛鉤的金融產品。S&P DOW JONES INDICES 概不對指數或任何相關數據或通訊(包括但不限於口頭與書面通訊，亦包含電子通訊)的充分性、準確性、及時性及/或完整性。S&P DOW JONES INDICES 概不對當中的任何錯誤、遺漏或遲延作出任何損害賠償或承擔任何法律責任。S&P DOW JONES INDICES 對元大投信、基金的持有人或其他人士或主體因使用指數或與指數有關的任何數據造成的後果，或針對任何特定目的或用途的適銷性或合適性，概不作任何明示或默示的保證。在不限制上文所述的情況下，S&P DOW JONES INDICES 概不對任何間接的、特殊的、附帶的、懲罰性的或相應而生的損害(包括但不限於利潤損失、交易損失、時間或商譽損失)承擔任何法律責任，即使其已獲悉可能會發生該等損害(不論屬於合約、侵權、嚴格法律責任或其他方面的損害)，亦然。S&P DOW JONES INDICES 與元大投信間的任何協議或安排，除S&P DOW JONES INDICES 的許可人外，概不存在任何第三方受益人。