

## 元大美國政府20年期(以上)債券單日反向1倍投資信託基金

(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	2017/01/11	保管銀行	華南商業銀行
基金規模	2.52億元	基金類型	跨國投資指數股票型_槓桿型/反向型_債券
基金淨值	20.878元	風險報酬等級	RR3
經理費*	0.75%	經理人	李政儒
保管費*	0.16%		

本基金為反向型指數股票型基金，係採用指數化策略，以追蹤標的指數(即「ICE 美國政府 20+ 年期債券 1 倍反向指數」)之報酬表現為投資目標。本標的指數係基於「ICE 美國政府 20+ 年期債券指數」之單日反向 1 倍報酬所編制及計算，本標的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會偏離同期間「ICE 美國政府 20+ 年期債券指數」之累積報酬，且偏離方向無法預估，故標的指數報酬所對應「ICE 美國政府 20+ 年期債券指數」反向 1 倍報酬僅限於單日，即本基金所追求之反向 1 倍報酬以標的指數單日報酬為限。本基金主要投資於「ICE 美國政府 20+ 年期債券 1 倍反向指數」或美國政府債券相關之有價證券及其他證券相關商品，惟本基金為策略交易型之指數股票型基金具反向操作風險，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。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，故基金風險報酬等級為RR3。

### 基金得獎紀錄

### 淨值走勢

(成立日2017/01/11)



### 投資特色

- (一) 追蹤ICE美國政府20+年期債券1倍反向指數，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。

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	-3.15	8.82	5.10	17.09	44.06	64.07	-3.15	4.50

(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	%

### 基金成分

期貨保證金	現金/RP
37.83%	62.14%

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

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「ICE 美國政府20+年期債券1倍反向指數」)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「ICE 美國政府 20+年期債券 1 倍反向指數」係基於「ICE 美國政府 20+年期債券指數」的單日報酬所編製及計算，以反應「ICE 美國政府20+年期債券指數」之單日反向 1 倍報酬表現。「ICE 美國政府 20+年期債券 1 倍反向指數」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「ICE 美國政府20+年期債券指數」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，並應簽署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標的為債券或期貨，因此匯率波動會影響基金淨值之計算，而計算盤中即時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，臺灣證券交易所時間與各國證券交易所時間因時差關係，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，因此計算盤中即時估計淨值與實際基金淨值計算之基金投組或有差異，投資人應注意盤中即時估計淨值與實際淨值可能有誤差之風險，經理公司於臺灣證券交易所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：元大美國政府 20 年期(以上)債券單日反向 1 倍基金係分別以「ICE 美國政府 20+年期債券 1 倍反向指數」(ICE U.S. Treasury 20+ Year Bond 1X Inverse Index)之全部或部分為基礎。該指數係由ICE Data Indices, LLC或其關係企業所擁有，且已由 ICE Data Indices, LLC 授權予元大投信使用。指數為 ICE Data Indices, LLC 與其關係企業之商標，並須經授權才可使用。指數係由 ICE Data Indices, LLC 及/或其關係企業所維護。ICE Data Indices, LLC 與元大投信或其關係企業並無附屬關係。元大投信已與 ICE Data Indices, LLC 就使用指數簽署授權契約。元大投信或基金並非由 ICE Data Indices, LLC 資助、擔保、分銷或推廣，且ICE Data Indices, LLC 對元大投信、基金或基金追蹤指數之能力不作出任何聲明及保證。ICE Data Indices, LLC 對指數及其包含之資料於特定目的之適銷性或適合性不作任何明示或暗示的保證，且排除任何的保證。ICE Data Indices, LLC 在任何情況下均不對任何特殊的、懲罰性的、直接或間接的或衍生的損害或損失(包括利潤損失)承擔任何責任，即使 ICE Data Indices, LLC 已告知該等損失或損害發生的可能性亦同。

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