元大標普高盛原油ER指數股票型期貨信託基金
(期貨 ETF)

基金簡介

成立日期	2015/08/27	保管銀行	永豐商業銀行
基金規模	23.11億元	基金類型	一般指數股票型期貨信託基金
基金淨值	17.4元	風險報酬等級	高波動度
經理費*	1.00%	經理人	黃議玄
保管費*	0.15%		

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

◎2024年《台北金融研究發展基金會》第27屆傑出基金金鑽獎-期貨ETF-一般型-3年期
◎2018年《指標》台灣年度基金大獎-最佳表現ETF大獎-原物料同級最佳獎
◎2015年《亞洲資產管理雜誌》最佳新ETF

資料來源：BENCHMARK指標雜誌、亞洲資產管理雜誌、台北金融研究發展基金會

淨值走勢

(成立日2015/08/27)

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	1.75	9.92	-5.43	8.89	-7.89	194.42	1.75	-12.96

(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

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。

投資組合

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	100.04%

以上資料來源：理柏資訊、投信投顧公會、期信公開資訊觀測站、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。
【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，亦可至期信基金資訊觀測站(www.fundclear.com.tw)下載公開說明書。

如本基金最近三十個營業日之基金平均單位淨資產價值較其最初單位淨資產價值累積跌幅達百分之九十時(即最近三十個營業日之基金平均單位淨資產價值為新臺幣貳元(含)以下)或本基金淨資產價值最近三十個營業日平均值低於新臺幣壹億元時，本期貨信託事業將報經金管會核准後終止期貨信託契約並進行下市及清算程序，投資人須承擔本基金下市日後，無法自行於初/次級市場賣出及僅就剩餘財產分配之風險。但因國內外經濟金融情勢變化，致本基金淨資產價值發生重大波動，得報金管會核准於一定期間不受前述規定限制。

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，並詳閱基金公開說明書。

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，本基金每日基金淨值，由經理公司公告之。

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同於原油現貨價格，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(TheNew 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。

本基金為達到追蹤標的指數報酬之目標，投資組合整體曝險部位將儘可能維持在一定之水位，故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(Daily Rebalancing)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。

本基金因應指數成分調整進行原油期貨交易Rebalance轉倉期間，滑價所造成價格差異等因素，可能造成基金績效無法完全緊貼標的指數表現。因滑價造成本基金需負擔較高交易成本，雖可藉由本基金所投資之其他有價證券、投資組合調整時所產生的正報酬等收入與之互抵，惟仍無法避免基金績效與標的指數績效產生偏離。

指數免責聲明：「標普高盛原油增強超額回報指數」(S&P GSCI Crude Oil Enhanced ExcessReturn)是 S&P Dow Jones Indices LLC(“SPDJI”)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’sFinancial 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。