元大標普美元ER單日正向2倍指數股票型期貨信託基金

(期貨 ETF；本基金為策略交易型產品，不適合長期持有，僅符合臺灣證券交易所訂定適格條件之投資人始得交易)

基金簡介

成立日期	2017/03/06	保管銀行	中國信託商業銀行
基金規模	2.46億元	基金類型	槓桿型指數股票型期貨信託基金
基金淨值	19.78元	風險報酬等級	中波動度
經理費*	0.80%	經理人	陳易廷
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31%者。

基金得獎紀錄

淨值走勢

(成立日2017/03/06)

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	-14.37	-20.75	-15.69	-8.34	-9.93	1.75	-20.75	-1.00

(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

1.首檔追求美元指數日報酬正向兩倍績效的槓桿型期貨ETF
2.資產配置的重要元件

投資組合

持倉契約名稱	持倉價值占AUM(月平均)
ICE美元指數期貨	200.25%

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：2025/06/30。

*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，不適合長期持有，僅符合臺灣證券交易所訂定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。

槓桿型或反向型期貨ETF係追蹤、模擬或複製指數之正向倍數或反向倍數表現，投資人應完全瞭解淨值與其指數間之正反向及倍數關係，且槓桿型或反向型期貨ETF僅以追蹤、模擬或複製每日指數報酬率正向倍數或反向倍數為目標，而非一段期間內指數正向倍數或反向倍數之累積報酬率，故不宜以長期持有槓桿型或反向型期貨ETF受益憑證之方式獲取累積報酬率。槓桿型或反向型期貨ETF不適合追求長期投資且不熟悉槓桿型或反向型期貨ETF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槓桿型或反向型期貨ETF之風險及特性。

本基金資產將高度集中交易於標的指數成分之期貨，故本基金淨資產價值會受到期貨價格波動影響，期貨價格漲跌將造成本基金淨資產價值之損益，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。

本基金投資標的指數之指數成分為美國洲際期貨交易所(ICE Futures U.S.)的單一月份美元指數期貨契約，惟所選之期貨契約，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(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：標普美元日報酬正向兩倍 ER 指數(S&P US Dollar Futures 2x Leverage Daily Index ER)（以下統稱“指數”）是 S&P Dow Jones Indices LLC（“SPDJI”）的一款產品，並已授權予元大投信使用。Standard & Poor’s® 與 S&P® 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；且這些商標已授權予 SPDJI 使用。SPDJI、Dow Jones、S&P 及其各自的附屬公司或其協力廠商許可人（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美元 ER 單日正向 2 倍指數股票型期貨信託基金（以下統稱”基金”）。S&P Dow Jones Indices 概不就一般地投資於證券或特別是投資於元大投信的基金的合理性或指數追蹤一般市場表現的能力，向元大投信的基金的所有人或任何公眾成員，做出任何明示或隱含的聲明或保證。就指數而言，S&P Dow Jones Indices 與元大投信的唯一關係，是指數及 S&P Dow Jones Indices的特定商標、服務標章和 / 或商品名的授權。指數由 S&P Dow Jones Indices確定、組成及測算，無需考慮元大投信或元大投信的基金。S&P Dow Jones Indices 在確定、組成或測算指數時概無義務考慮元大投信或元大投信的基金的所有人的需求。S&P Dow Jones Indices 概不負責且不參與確定元大投信的基金的價格和數量，或是元大投信的基金的發行或銷售時間，亦不負責且不參與確定或測算相關公式以將元大投信的基金轉換為現金、或退回或贖回元大投信的基金（視情況而定）。S&P Dow Jones Indices 就元大投信的基金的經營、行銷或交易概不承擔任何義務或法律責任。概不保證基於指數的投資產品能夠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。將某個期貨合同納入指數並非 S&P Dow Jones Indices 關於購買、銷售或持有該合同的建議，亦不能被視作投資建議。儘管上文已做出規定，Inter Continental Exchange Inc.及其附屬公司仍可獨立發行和 / 或保薦與元大投信目前正在發行的元大投信的基金無關、但可能與元大投信的基金相類似且相競爭的金融產品。此外，Inter Continental Exchange Inc.及其附屬公司還可交易與指數表現掛勾的金融產品。此種交易活動有可能會對指數和元大投信的基金的價值造成影響。
S&P DOW JONES INDICES 概不保證指數或任何相關資料或通訊（包括但不限於口頭或書面通訊，包括電子通訊）的充分性、準確性、及時性和 / 或完整性。S&P DOW JONES INDICES 概不對當中的任何錯誤、遺漏或延遲做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、元大投信的基金的所有人或任何其他人士或實體因使用指數或與指數有關的任何資料造成的後果，或者針對任何特定目的或用途的適銷性或合適性，概不作任何明示或隱含的保證，並且明確放棄這方面的的一切保證。在不限制前述任何規定的情況下，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，即使該等公司知悉在合同、侵權法、嚴格法律責任或其他方面可能發生該等損害，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，概不存在任何協力廠商受益人。

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；電話：(04)2232-7878；一百一十四金管投信新分字第零零肆號

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