元大標普日圓ER單日反向1倍指數股票型期貨信託基金 (期信ETF，期元大S&P日圓反100707R)

1.首檔追求日圓期貨日報酬反向一倍績效的反向型期貨ETF
2.資產配置的重要元件

基金簡介

經理人	黃議玄	保管費	0.15%
成立日期	2017/08/23	標準差(24個月)	--
基金規模	1.95億元	貝他值(24個月)	--
基金淨值	28.41元	夏普值(24個月)	--
保管銀行	玉山商業銀行	風險報酬等級	中波動度
經理費	0.80%	適合投資人	中波動承受型

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32%者。

基金得獎紀錄

前10大RP交易對象

持倉契約名稱	持倉價值占AUM (月平均)	持倉契約名稱	持倉價值占AUM (月平均)
CME日圓期貨	-99.79%		
合計	-99.79%		

累積報酬率(%)

期 間	3個月	6個月	1年	2年	3年	5年	今年以來	成立以來
績 效	2.30	5.38	15.16	37.25	46.67	39.54	7.37	42.19

(註：累積報酬率係以基金本身計價幣別(即原幣)計算)

成立以來基金淨值表現 / 單位：新台幣

(成立日2017/08/23)

以上資料來源：理柏、公會、元大投信。資料截止日期：2024/02/29。
(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)

【元大投信獨立經營管理】本期貨信託基金經金融監督管理委員會同意生效或核准，惟不表示本基金絕無風險。本公司以往之經理績效不保證本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，不負責本基金之盈虧，亦不保證最低之收益。本文提及之經濟走勢預測不必然代表本基金之績效，本基金投資風險請詳閱基金公開說明書。有關各基金應負擔之相關費用(包括但不限於基金經理費、保管費、指數授權費、上市費、因投資或交易所衍生之費用或稅負、證券集中保管相關費用、換匯相關費用等)，已揭露於基金公開說明書中，投資人可向本公司及各基金銷售機構索取，或至本公司網站(www.yuantafunds.com)或期信基金資訊觀測站中查詢。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。**本基金上市日前(不含當日)，經理公司不接受本基金受益權單位之買回。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，並詳讀本公開說明書。**基金受益憑證上市後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依臺灣證券交易所有關規定辦理。**本基金之每單位淨資產價值可能因跨時區交易而無法揭露最新淨值，標的指數成分契約之價格、基金淨資產價值及證券交易市場之市場價格可能受期貨契約標的現貨之價格影響，而可能產生折、溢價之風險，且專業投資人通常較一般投資人容易取得期貨契約及期貨契約標的現貨之資訊及評價，投資人於現金申購、買回或於證券交易市場買賣前，應審慎評估價格之合理性，並詳閱基金公開說明書。槓桿型或反向型期貨ETF係追蹤、模擬或複製標的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標的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、模擬或複製每日標的指數報酬率正向倍數或反向倍數為目標，而非一段期間內標的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。**本基金之操作目標為在追蹤各基金標的指數相關之報酬，而標的指數成分股票或期貨價格波動(包括但不限於受利多、利空或除息等因素影響)將影響各基金標的指數的走勢，然各基金追求標的指數報酬之目標，不因標的指數劇烈波動而改變。本基金雖以追蹤各基金標的指數相關報酬為目標，惟可能因匯率、基金應負擔費用、期貨交易轉倉滑價等因素而使基金報酬未能完全緊貼標的指數報酬而產生追蹤偏離，且偏離方向無法預估。本基金係以交易期貨為主，申購人應了解期貨價格不等同於現貨價格，兩者之間可能存在價格差異。有關本基金之投資風險請投資人詳閱本基金公開說明書。【指數免責聲明】標普日圓期貨日報酬正向 2 倍 ER 指數(S&P Japanese Yen Futures 2x Leverage Daily ER Index)、標普日圓期貨日報酬反向 1 倍 ER 指數(S&P Japanese Yen Futures 1x Inverse Daily ER Index)及標普高盛黃金日報酬正向兩倍 ER 指數 (S&P GSCI Gold 2x Leveraged 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；GSCI® 是 The Goldman Sachs Group, Inc.(“高盛”)的註冊商標；且 這些商標已授權予 SPDJI 使用。高盛或其附屬公司並不制定、擁有、擔保、 保薦、銷售或推廣該指數且高盛集團不對該指數或其相關資料承擔任何責任。 SPDJI、Dow Jones、S&P、高盛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日 圓 ER 單日正向 2 倍指數股票型期貨信託基金、元大標普日圓 ER 單日反向 1 倍指數股票型期貨信託基金及元大標普高盛黃金 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 7 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，CME Group 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，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。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：106 台北市大安區敦化南路二段 69 號 18 樓、67 號 B1
台中分公司：406台中市崇德路二段46之4號5樓
客服專線0800-009-968·(02)8770-7703