

街口標普高盛布蘭特原油 ER 單日正向 2 倍指數股票型期貨信託基金

(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)

投資特色

國內首檔追蹤布蘭特原油期貨指數正向 2 倍績效的槓桿型 ETF。標的指數之成分係為單一月份英國洲際歐洲期貨交易所(ICE EU)布蘭特原油期貨契約，該原油期貨契約具有指標性參考性，是目前布蘭特原油投資及避險的有效工具。

投資配置

前五大期貨契約	期貨代號	口數	持倉價值佔比%
202112 布蘭特期貨	B 202112	6174	200.65

資金配置

資產類別	佔比%	主要貨幣	佔比%
期貨保證金	103.72	美元	91.01
存款	4.27	新臺幣	8.99
其他	-7.99		

基本資料

成立日	106/11/08
基金類型	槓桿型期貨 ETF
風險屬性	高波動度
註冊地	臺灣
計價幣別	新臺幣
基金規模	67.15 億新臺幣
經理公司	街口投信
基金經理人	曹君龍
保管機構	臺灣銀行
經理費	1.00%
保管費	0.15%
追蹤指數	標普高盛布蘭特原油日報酬正向兩倍 ER 指數
指數授權費	以基金資產淨值之 5bps 計算，最小年費美金 15,000 元，兩者取較高者為給付。

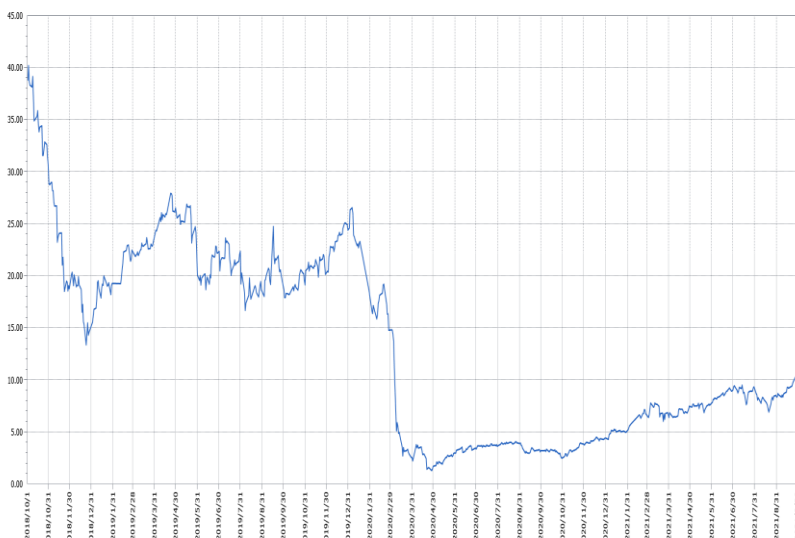
本基金自一一〇年一月一日起由曹君龍擔任基金經理人

投資表現

單筆投資	累積報酬%
近 3 月	12.86
近 6 月	59.31
今年以來	130.32
近一年	218.13
近二年	-49.30
近三年	-72.40
成立以來	-49.10

本月報資料與數據來源：街口投信 · Lipper · 110年9月底

近三年淨值走勢



街口標普高盛布蘭特原油 ER 單日正向 2 倍指數股票型期貨信託基金

(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)

【街口投信獨立經營管理】本期貨信託基金經目的事業主管機關核准，惟不表示本基金絕無風險。本期貨信託事業以往之績效不保證基金之最低投資收益；本期貨信託事業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，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，投資人可至期信基金資訊觀測站中查詢。**本基金投資無受存款保障、保險安定基金或其他相關機制之保障，投資人需自負盈虧。基金投資可能產生的最大損失為全部本金。**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之現貨價格影響，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。本基金於上市日後，本公司於臺灣證券交易所時間內提供盤中估計淨值僅供投資人參考，估計淨值與實際淨值可能有誤差值風險，本基金實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。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，並詳讀本基金公開說明書。**本基金之標的指數為「S&P GSCI Brent Crude 2X Leveraged ER Index」(標普高盛布蘭特原油日報正向兩倍超額回報指數，簡稱標普高盛布蘭特原油日報正向兩倍 ER 指數)，指數名稱為指數提供者提供並授權本基金使用，指數名稱中所列「超額回報」係指數提供者中譯「Excess Return」之文字，並非對標的指數或本基金績效表現有超額回報或投資獲利之暗示或保證。標的指數報酬以反應指數成分布蘭特原油期貨契約表現為主，而本基金之績效表現亦視標的指數成分期貨契約之表現及本基金追蹤標的指數之成效而定。故投資人投資本基金可能產生利益或發生損失。本基金資產將高度集中交易於標的指數成分之布蘭特原油期貨，故本基金淨資產價值會受到布蘭特原油期貨價格波動影響，如槓桿型基金受到布蘭特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，本基金係以交易布蘭特原油期貨為主，申購人應了解布蘭特原油期貨價格不同於布蘭特原油現貨價格，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英國國際歐洲期貨交易所(Intercontinental Exchange Europe·ICE EU)布蘭特原油期貨契約，惟所選之布蘭特原油期貨契約，係指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。本基金雖以追蹤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、指數編製規則改變或指數計算錯誤等因素而使本基金報酬與標的指數報酬產生追蹤偏離，且偏離方向無法預估。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，投資人於本基金掛牌上市前申購所買入的每單位淨資產價值，不同於基金掛牌上市後之價格，於本基金掛牌上市前申購之投資人需自行承擔自申購日起至上市掛牌日止期間之基金價格波動所產生折/溢價的風險。本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。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，投資人首次委託買賣或申購、買回槓桿/反向指數股票型期貨信託基金受益憑證時，應符合適格性條件如下之一：(i)已開立信用交易帳戶；(ii)最近一年內委託買賣認購(售)權證成交達十筆(含)以上；(iii)最近一年內委託買賣臺灣期貨交易所上市之期貨交易契約成交達十筆(含)以上；如因前述法規修訂者，從其規定辦理。故於本基金成立日前申購基金受益憑證之受益人或上市日後委託證券商買賣或申購、買回者均需符合臺灣證券交易所訂定之適格條件始得交易，並應簽具與證券交易所訂定內容相符之風險預告書，期貨信託公司、基金銷售機構或參與證券商始得接受其交易。本基金所訴求之正向倍數或反向倍數報酬率僅限於單日報酬。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。本基金係採用指數化策略，以追蹤標的指數之報酬表現為投資目標，本基金具有槓桿操作或反向操作風險，其投資盈虧深受市場波動與複利效果影響，與傳統指數股票型期貨信託基金不同，故不適合追求長期投資且不熟悉本基金所訴求之正向倍數或反向倍數報酬率僅限於單日報酬之投資人。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。本基金之長期報酬率會偏離指數之正向倍數或反向倍數表現之釋例說明如下，或請詳見本基金公開說明書：**

情境一：強勢走升(第一天上漲10%，第二天上漲10%) 各類型基金模擬價格及報酬(指數價格以100起算)					情境二：先漲後跌(第一天上漲10%，第二天下跌9%) 各類型基金模擬價格及報酬(指數價格以100起算)					情境三：先跌後漲(第一天下跌10%，第二天上漲9%) 各類型基金模擬價格及報酬(指數價格以100起算)					情境四：弱勢走跌(第一天下跌10%，第二天下跌10%) 各類型基金模擬價格及報酬(指數價格以100起算)				
日	T日	T+1日	T+2日	整體報酬	日	T日	T+1日	T+2日	整體報酬	日	T日	T+1日	T+2日	整體報酬	日	T日	T+1日	T+2日	整體報酬
原型	100	110	121	21.0%	原型	100	110	100.1	0.1%	原型	100	90	98.1	-1.9%	原型	100	90	81	-19.0%
槓桿兩倍型	100	120	144	44.0%	槓桿兩倍型	100	120	98.4	-1.6%	槓桿兩倍型	100	80	94.4	-5.6%	槓桿兩倍型	100	80	64	-36.0%
反向一倍型	100	90	81	-19.0%	反向一倍型	100	90	98.1	-1.9%	反向一倍型	100	110	100.1	0.1%	反向一倍型	100	110	121	21.0%

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，因此本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。標普高盛布蘭特原油日報正向兩倍 ER 指數(S&P GSCI Brent Crude 2X Leveraged ER Index)是 S&P Dow Jones Indices LLC(“SPDJ”)的一款產品，且已授權予街口投信使用。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；這些商標已授權予 SPDJ 使用。高盛或其附屬公司並不制定、擁有、擔保、推薦、銷售或推廣該指數，且高盛不該指數或其相關資料承擔任何責任。SPDJ、Dow Jones、S&P、高盛或其各自的任何附屬公司或其協力廠商許可人均不保薦、擔保、銷售或推廣街口投信的街口標普高盛布蘭特原油 ER 單日正向 2 倍指數股票型期貨信託基金。SPDJ、Dow Jones、S&P、高盛或其各自的任何附屬公司或其協力廠商許可人均不 (i) 對投資這類產品的明智性作出任何保證，或 (ii) 保證該指數或其任何相關資料的準確性和/或完整性。街口投信已就可靠資料或來源提供適當之意見與消息，但不保證資料來源之完整性，如有任何遺漏或疏忽，請即通知本公司修正，本公司或關係企業與其任何董事或受僱人，對此不負任何法律責任。