

街口道瓊銅 ER 指數股票型期貨信託基金

投資特色

標的指數之成分為單一月份美國紐約商品交易所(COMEX)高級銅期貨契約，以指數化操作策略追蹤高級銅期貨價格表現，提供投資人或避險需求者波段操作之交易工具。

投資配置

前五大期貨契約	期貨代號	口數	持倉價值佔比%
202112 高級銅期貨	HG 202112	187	100.52

資金配置

資產類別	佔比%	主要貨幣	佔比%
期貨保證金	66.84	新臺幣	70.64
存款	33.25	美元	29.36
其他	-0.09		

成立以來淨值走勢



街口道瓊銅 ER 指數股票型期貨信託基金

【街口投信獨立經營管理】本期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。本基金於上市日後，本公司於臺灣證券交易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，並詳讀本公開說明書。本投資之標的指數為「Dow Jones Commodity Index North American Copper ER」(道瓊銅 ER 指數)，指數名稱指指數提供者提供並授權本基金使用，指數名稱中所列「ER」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高級銅期貨契約表現為主，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高級銅期貨，故本基金淨資產價值會受到高級銅期貨價格波動影響，如高級銅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，本基金係以交易高級銅期貨為主，申購人應了解高級銅期貨價格不同於銅現貨價格，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品交易所(Commodity Exchange, Inc. COMEX)高級銅期貨契約，惟所選之高級銅期貨契約，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。本基金難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所有規定辦理。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。「道瓊銅 ER 指數」(Dow Jones Commodity Index North American Copper ER)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、保薦、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、銷售或推廣街口道瓊銅 ER 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。

基本資料

成立日	107/12/12
基金類型	指數股票型
風險屬性	中波動度
註冊地	臺灣
計價幣別	新臺幣
基金規模	5.30 億新臺幣
經理公司	街口投信
基金經理人	黃昇平
保管機構	永豐商銀
經理費	1.00%
保管費	0.15%
追蹤指數	道瓊銅 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。

投資表現

單筆投資	累積報酬%
近 3 月	-4.79
近 6 月	0.96
今年以來	14.33
近一年	31.26
近二年	43.22
近三年	N/A
成立以來	32.05

本月報資料與數據來源：街口投信、Lipper、110年9月底