

群益臺灣加權指數單日反向1倍基金

Capital TaieX Daily Inversed -1X ETF

01.基金特色

1. 臺指為最具代表性的台股指數，在台股市場中成立時間最久、市值涵蓋率最高，為最適合衡量台股整體趨勢的指標。
2. 群益臺灣加權反1 ETF與台股連動性高，未來預期台股趨勢向下，可利用反向型ETF進行策略投資，不僅可達到避險效果，更可在逆境中創造獲利機會，提高投資勝率。

02.基金小檔案

基金成立日	2017/3/23	基金經理人	洪祥益
ETF 上市日	2017/3/30	掛牌交易所	臺灣證交所
彭博代碼	00686R TT	股票代碼	00686R
基金型態	指數股票型	基金屬性	RR5
基金規模	2.58億新台幣	單月日均量	2840張
經理費	0.30% / 年	保管費	0.04% / 年
是否配息	否	保管銀行	玉山商業銀行
投資標的	本基金係採用指數化策略，以追蹤標的指數「臺指反向一倍指數」為目標		
基金淨值	2.01元新台幣	ETF收盤價	2.01元新台幣
計價幣別	新台幣	追蹤指數	TTDRIN Index

03.投資策略

群益臺灣加權反1 ETF因應申購/贖回之需求，將持續採用指數化操作策略，運用證券相關商品曝險部位，逐日調整基金投資組合之整體曝險部位貼近本基金淨資產價值之-100%，以達到追蹤臺指反向一倍指數績效表現為目標。

04.主要投資標的

種類	名稱	持股權重
期貨	台股指數期貨	95.88%
期貨	小型台指期貨	3.69%

05.基金績效(%)

	一季	半年	一年	二年	三年	五年	成立以來	標準差(12月)
淨值報酬	-17.28	-7.80	-14.83	-36.59	-48.46	-64.92	-79.90	17.03
市價報酬	-17.62	-8.22	-15.19	-36.59	-48.85	-64.86	-79.90	17.08

1. 年化標準差為衡量報酬率波動程度，數值愈低，代表報酬穩健，波動程度較低，本資料取較長評估期間，即12個月
2. 資料來源：Morningstar、群益投信
3. 資料整理：群益投信 數據資料：截至2025/7/31止

本單元資料僅供參考並非投資依據，請勿視為買賣基金或其他任何投資之建議。本公司所作任何投資意見與市場分析資料，係依據資料製作當時情況進行分析判斷，本公司已力求資訊之正確與完整，惟文中之數據、預測或意見恐有疏漏或錯誤之處，或因市場環境變化而變更，投資標的價格與收益亦將隨時變動，恕不保證其完整性。本基金經金管會核准或同意生效，惟不表示絕無風險。基金經理公司以往之經理績效不保證基金之最低投資收益；基金經理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，投資人申購前應詳閱基金公開說明書或簡式公開說明書，有關基金應負擔之費用已揭露於基金公開說明書或簡式公開說明書中，投資人可向本公司及基金銷售機構索取，或至公開資訊觀測站及本公司網站中查詢。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。若基金有配息，基金配息率不代表基金報酬率，且過去配息率不代表未來配息率；基金淨值可能因市場因素而上下波動。內容涉及新興市場部分，因其波動性與風險程度可能較高，且其政治經濟情勢穩定度可能使資產價值受不同程度之影響，此外匯率走勢亦可能影響所投資之海外資產價值變動。投資人因不同時間進場，將有不同之投資績效，過去之績效亦不代表未來績效之保證。相關資產配置比重，係依目前市況而定，本基金之實際配置，經理公司將依實際市場狀況進行調整。投資人投資以高收益債券為訴求之基金不宜占其投資組合過高之比重。由於高收益債券之信用評等未達投資等級或未獲信用評等，且對利率變動的敏感度甚高，故本基金可能會因利率上升、市場流動性下降，或債券發行機構違約不支付本金、利息或破產而蒙受虧損。本基金不適合無法承擔相關風險之投資人。基金經理公司以往之經理績效不保證基金之最低投資收益；基金經理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，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。本公司已自臺灣證券交易所股份有限公司取得使用臺灣證券交易所發行量加權股價指數之授權。群益台股指數基金並非由臺灣證券交易所股份有限公司(「證交所」)贊助、許可、銷售或推廣；且證交所不負責臺灣證券交易所發行量加權股價指數及/或該指數於任何特定日期、時間所代表數字之預期結果提供任何明示或默示之擔保或聲明。臺灣證券交易所發行量加權股價指數係由證交所所編製及計算；惟證交所不負責臺灣證券交易所發行量加權股價指數之錯誤承擔任何過失或其他賠償責任；且證交所無義務將指數中之任何錯誤告知任何人。可配息基金進行配息前未先扣除應負擔之相關費用，可配息基金的配息可能由基金的收益或本金中支付。任何涉及由本金支出的部份，可能導致原始投資金額減損。基金配息率不代表基金報酬率，且過去配息率不代表未來配息率；基金淨值可能因市場因素而上下波動。投資人於獲配息時，宜一併注意基金淨值之變動，本公司備有近12個月內由本金支付配息之相關資料於本公司官網供查詢。參酌中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會「基金風險報酬等級分類標準」編製，該分類標準係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級為RR1~RR5，數字越大代表風險越高。此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險，不宜作為投資唯一評估依據，投資人仍應充分評估基金的投資風險。

06.成立以來基金淨值走勢



07.參與券商

名稱	名稱
群益金鼎證券	中國信託綜合證券
國票綜合證券	兆豐證券
統一綜合證券	第一金證券
玉山綜合證券	合作金庫證券
凱基證券	臺銀綜合證券
永豐金證券	國泰綜合證券
富邦綜合證券	元大證券
台新綜合證券	

08.流動量提供券商

名稱	名稱
永豐金證券	群益金鼎證券
國票綜合證券	富邦綜合證券
凱基證券	元大證券