本基金採現金申購買回作業

群益臺灣加權指數ETF傘型證券投資信託基金之群益臺灣加權指數單日正向2倍證券投資信託基金

簡式公開說明書

刊印日期：114年7月31日

(一)本簡式公開說明書係公開說明書之重點摘錄，相關名稱及文字定義與公開說明書完全相同。

(二)投資人申購本基金後之權利義務詳述在公開說明書，投資人如欲申購本基金，建議參閱公開說明書。

壹、基本資料

基金名稱	群益臺灣加權指數單日正向2倍基金	**成立日期**	106年3月23日
經理公司	群益證券投資信託股份有限公司	**基金型態**	開放式
基金保管機構	玉山商業銀行股份有限公司	**基金種類**	指數股票型
受託管理機構	無	**投資地區**	國內
國外投資顧問公司	無	**存續期間**	不定期限
收益分配	無	**計價幣別**	新臺幣
績效指標benchmark	臺指日報酬兩倍指數（非客製化指數）	**保證機構**	無；本基金非保證型基金
集中市場交易幣別	新臺幣	**保證相關重要資訊**	無

貳、基金投資範圍及投資特色

一、投資範圍：

自上市日起，本子基金投資組合之整體曝險部位應貼近本子基金淨資產價值之正向 2 倍之 100%（含），且為因應標的指數之正向倍數表現複製策略及資金調度之需要，從事證券相關商品交易曝險部位，本子基金每營業日所持有證券相關商品之契約總市值或總（名目）價值之合計數，不得超過本子基金淨資產價值之 220%（含）。本子基金採用指數化策略進行投資，考量基金規模及標的指數點位，使本子基金投資標的指數成分股加計證券相關商品之整體曝險部位，於扣除各項必要費用後，儘可能達到追蹤標的指數之績效表現，並兼顧控制追蹤誤差值為投資管理目標。

二、投資特色：

本群益臺灣加權指數 ETF 傘型基金二檔子基金分別以追蹤臺指日報酬兩倍指數及臺指反向一倍指數績效表現為目標，可滿足投資人於多頭市場或空頭市場時，利用槓桿型 ETF 及反向 ETF 進行多空操作，因應不同市場行情做出最佳投資決策。

三、標的指數之簡介：

臺指日報酬兩倍指數為非客製化之「臺灣證券交易所發行量加權股價指數」(後簡稱加權指數）的單日正向兩倍報酬之績效表現。

參、投資本基金之主要風險

一、 本基金投資績效表現將視所追蹤標的指數的走勢而定，當標的指數價格波動劇烈或下跌時，本基金之淨資產價值將有大幅波動的風險。

二、 特定投資策略之風險

槓桿型 ETF 為運用不同的交易策略來達到財務槓桿倍數的效益，除了所連結的指數外，也能投資相關的衍生性金融商品以達到財務槓桿的效果。前述類型不若傳統型 ETF 單純，故會有追蹤誤差風險。另槓桿型 ETF 係以較少的投入金額追求高於指數變動的報酬，若判斷交易市場上漲機率高時，可藉由槓桿型 ETF 加速獲利，反之，將可能承受較大的損失。

三、 本基金為指數股票型基金，所追蹤之標的指數為臺指日報酬兩倍指數，臺指日報酬兩倍指數是以加權指

數的單日正向兩倍報酬之績效表現，本基金風險報酬等級為 RR5。＊風險報酬等級為本公司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，分類為 RR1~RR5 五級，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（如：基金計價幣別匯率風險、投資標的產業風險、信用風險、利率風險、流動性風險等），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，更多基金評估之相關資料(如年化標準差、Alpha、Beta 及 Sharp 值等可至中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會網站之「基金績效及評估指標查詢專區」(https://www.sitca.org.tw/index_pc.aspx)查詢。

四、 有關本基金之詳細投資風險，請參見公開說明書「壹、五、投資風險揭露」內容說明。

肆、本基金適合之投資人屬性分析

一、 本子基金為槓桿型指數股票型基金，所追蹤標的指數為「臺指日報酬兩倍指數」，定位為策略交易型投資產品，投資風險較高，不適合長期持有及不熟悉本基金之投資人。

二、 適合以追求單日報酬為投資目標且能承受一定風險之積極型投資人，且符合臺灣證券交易所訂適格條件之投資人，並簽具風險預告書始得交易。本基金具有槓桿投資風險，其投資盈虧深受市場波動與複利效果影響，有別於傳統的一般指數股票型基金。

伍、基金運用狀況

一、 基金淨資產組成：

群益臺灣加權單日正向2倍基金

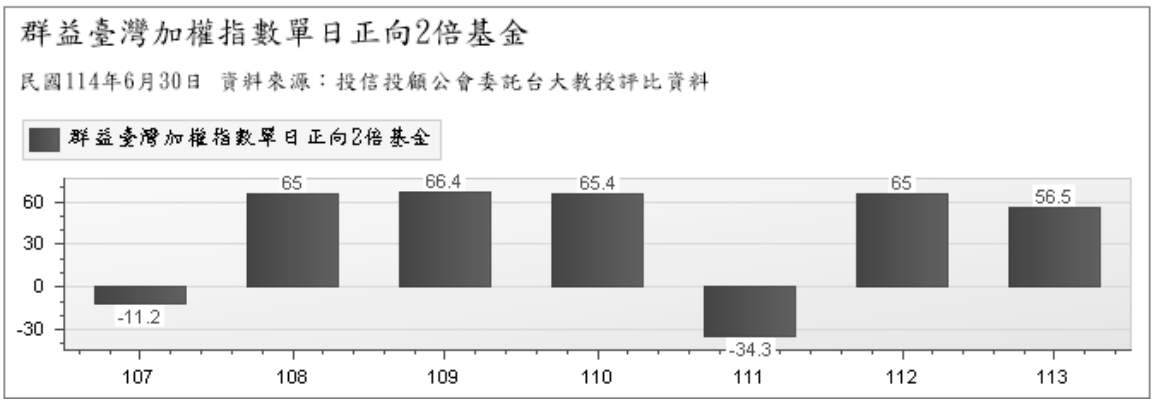
資料日期：114年6月30日

投資類別	投資金額(基準幣百萬元)	佔基金淨資產價值比重(%)
其他資產(扣除負債後)	1,730.75	72.93
附條件交易	483.08	20.36
銀行存款	159.18	6.71

資料來源：群益投信

二、最近十年度基金淨值走勢圖：

二、 最近十年度各年度基金報酬率：



註：1.年度基金報酬率：指本基金淨資產價值，以 1~12 月完整曆年期間計算，加計收益分配後之累計報酬率。
2.收益分配均假設再投資於本基金。

四、基金累計報酬率：

群益臺灣加權單日正向2倍基金

資料日期：114年6月30日

期　　間	最近三個月	最近六個月	最近一年	最近三年	最近五年	最近十年	基金成立日(106年3月23日)起算至資料日期日止
累計報酬率	12.19%	-10.55%	-14.57%	121.22%	349.35%	N/A	662.10%

資料來源：投信投顧公會委託台大教授評比資料

群益臺灣加權指數單日正向2倍基金 2017/3/23

	三個月	六個月	一年	三年	五年	十年	成立以來
群益臺灣加權指數單日正向2倍基金	12.19%	-10.55%	-14.57%	121.22%	349.35%	N/A	662.10%
基準指標	11.69%	-10.72%	-13.41%	99.33%	206.59%	N/A	289.39%

資料來源：群益投信整理；資料日期：2025/6/30 基準幣 TWD

註:1. 累計報酬率：指至資料日期日止，本基金淨資產價值最近三個月、六個月、一年、三年、五年、十年及自基金成立日起算，加計收益分配之累計報酬率。 2. 收益分配均假設再投資於本基金。備註：差異比較之計算基礎，基金和指數皆用含息報酬計算

五、最近十年度各年度每受益權單位收益分配之金額：無。

六、最近五年度各年度基金之費用率：

群益臺灣加權單日正向2倍基金

年度	109	110	111	112	113
費用率	1.02%	0.91%	1.02%	0.75%	0.50%

註:費用率：指依證券投資信託契約規定基金應負擔之費用（如：交易直接成本—手續費、交易稅；會計帳列之費用—經理費、保管費、保證費、財務報告簽證或核閱費用及其他費用等）占平均基金淨資產價值之比率。

陸、受益人應負擔費用之項目及其計算方式

項目		計算方式或金額
經理費		每年為本基金淨資產價值之0.3%。
保管費		每年為本基金淨資產價值之0.04%。
指數授權費		(1)於上市日起及其後每屆滿一週年，按每週年度本子基金平均淨資產價值之0.02%計算或新臺幣四十萬元兩者孰高者支付。 (2)第一年之授權費，應於指數授權契約生效日支付新臺幣二十萬元予指數提供者，再於本子基金上市日支付新臺幣二十萬元予指數提供者。本子基金自上市日起屆滿一週年時，若本子基金該週年度按平均淨資產價值之0.02%所計算出之金額高於新臺幣四十萬元時，應將該差額支付予指數提供者。
上市費		(1)每年為本子基金淨資產價值之0.03%，最高金額為新臺幣三十萬元。 (2)上市當年度按月數比例計收，不足一個月者按一個月份計算。
召開受益人會議費		每年預估新臺幣壹佰萬元。
其他費用		以實際發生之數額為準。
透過初級市場申購買回費用	申購手續費	(1)本子基金成立日（不含當日）前，申購手續費最高不得超過發行價額之2%，依投資人所申購之發行價額，由基金銷售機構與投資人自行議定之。 (2)本子基金上市日（含當日）起，申購手續費最高不得超過每現金申購基數約當市值之2%，由參與證券商與申購人自行議定之。 (3)本子基金每現金申購基數為伍拾萬個受益權單位數。
	申購交易費	申購交易費＝實際申購價金＊申購交易費率 目前收取標準自106年8月21日起為0.02%，該費率得依證券市場現況、投資組合交易部位需要調整之，實際收取最高以每一現金申購基數所表彰之受益權單位數乘以每受益權單位淨資產價值2%為限。
	買回手續費	(1)買回手續費最高不得超過買回總價金之2%由參與證券商與受益人自行議定之。 (2)本子基金另得於給付買回總價金時，扣除匯費等費用。 (3)本子基金每現金買回基數為伍拾萬個受益權單位數。
	買回交易費	買回交易費＝買回價金＊買回交易費率 目前收取標準自106年8月21日起為0.02%，該費率得依證券市場現況、投資組合交易部位需要調整之，實際收取最高以每一現金買回基數所表彰之受益權單位數乘以每受益權單位淨資產價值2%為限。
	行政處理費	申購人若發生申購失敗、受益人若發生買回失敗時，應支付行政處理費。

柒、受益人應負擔租稅之項目及其計算

本基金投資國內資本市場之稅賦事項，均依財政部有關法令辦理，受益人可能負擔之租稅主要包括本基金所

投資商品之各項交易稅及所得稅款等。詳細內容請參見本基金公開說明書第27頁。

捌、基金淨資產價值之公告時間及公告方式

一、公告時間：本基金每營業日公告前一營業日每受益權單位淨值。

二、公告方式：於經理公司群益投信理財網（http://www.capitalfund.com.tw）公告。

玖、公開說明書之取得

一、本基金公開說明書備置於經理公司及其基金銷售機構營業處所，投資人可免費索取。

二、投資人亦可於群益投信理財網（http://www.capitalfund.com.tw）及公開資訊觀測站（http://mops.twse.com.tw）免費取得本基金公開說明書及基金近年度財務報告電子檔。

其他

無

本基金經金融監督管理委員會核准，惟不表示本基金絕無風險。本證券投資信託事業以往之經理績效不保證本基金之最低投資收益；本證券投資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。本基金並無受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障，基金投資可能發生部分或全部本金之損失，投資人須自負盈虧。

本基金具有槓桿投資風險，其投資盈虧深受市場波動與複利效果影響，與傳統指數股票型基金不同。本基金不適合追求長期投資且不熟悉本基金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。投資人首次交易本基金時，限應符合臺灣證券交易所訂定投資人之適格條件，並簽具風險預告書，始得交易。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數之買回。本基金上市後之買賣成交價格之升降幅度限制為 20%，且應依臺灣證券交易所之相關規定辦理。

群益投信服務電話　台北：(02)2706-7688、台中：(04)2301-2345、高雄：(07)335-1678