



元大投信ETF月報

2024年01月

©指數暨量化投資事業群 編制

本報告純屬研究性質，不保證其完整性及精確性，且不提供或嘗試遊說客戶做為買賣股票之投資依據。報告中所有相關數據，係取自本公司相信為可靠之資料來源，且為特定日期所為之判斷，有其時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。投資人於決策時應審慎衡量本身風險，並就投資結果自行負責。以上報告，禁止任何形式之抄襲、引用或轉載。

◆ The Date of Publication: 2024.01



FAST VIEW

本月要點

01

元大量化研究

-因子報酬分析

P.03

02

ETF投資資訊

-債券ETF殖利率統計表

P.04

更多市場即時資訊?
請見 <[元大ETF日訊](#)>





MAIN CONTENT

因子報酬分析

本月台股強勢因子

元大投信建議投資人擇優篩選殖利率、盈餘品質、獲利能力及益本比等納入基本面因子之ETF，首推元大高息低波ETF(00713)(本基金之配息來源可能為收益平準金)，是市場中唯一納入多個品質與價值因子的ETF，在同業競品中具有獨特性。

本月強勢因子：

排名	因子	月超額報酬
1	殖利率	2.1%
2	成長	1.3%
3	益本比	0.2%

今年強勢因子：

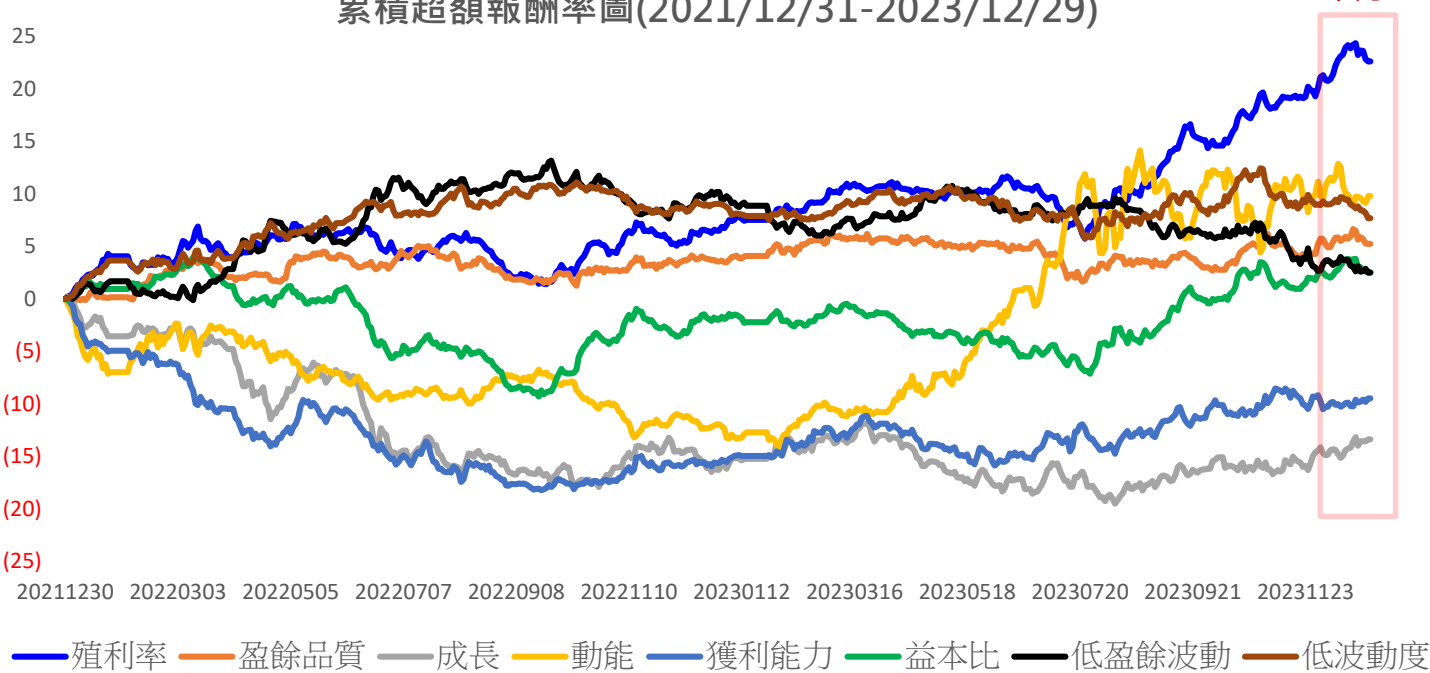
排名	因子	YTD超額報酬
1	動能	24.7%
2	殖利率	15.2%
3	獲利能力	7.3%

去年以來台股8大因子之超額報酬拆解：

八因子	2023												2023			
	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	1-11月	12月	YTD	YTD排序
殖利率	1.4%	1.1%	1.4%	-0.5%	-0.2%	0.0%	-2.0%	3.7%	2.4%	4.6%	0.4%	2.1%	12.8%	2.1%	15.2%	2
盈餘品質	0.9%	1.0%	0.2%	-0.3%	-0.1%	-0.6%	-1.9%	1.0%	-0.6%	2.7%	-0.5%	0.0%	1.6%	0.0%	1.6%	6
成長	1.4%	1.9%	0.6%	-2.9%	-2.0%	-0.5%	-1.1%	0.7%	2.2%	0.0%	2.0%	1.3%	2.2%	1.3%	3.5%	5
動能	-1.5%	3.5%	-0.7%	2.6%	6.0%	4.6%	5.3%	3.1%	1.7%	-6.4%	6.0%	-1.2%	26.3%	1.2%	24.7%	1
獲利能力	0.6%	2.8%	1.0%	-2.2%	-1.2%	0.9%	0.0%	1.0%	3.0%	0.5%	1.1%	-0.3%	7.7%	-0.3%	7.3%	3
益本比	0.3%	0.0%	0.3%	-1.7%	-0.4%	-1.9%	-0.3%	2.7%	2.7%	3.9%	-1.1%	0.2%	4.4%	0.2%	4.6%	4
低盈餘波動	-2.5%	-1.3%	1.7%	1.4%	-0.2%	-0.7%	0.4%	-1.7%	-1.1%	0.9%	-3.9%	-0.2%	-6.8%	-0.2%	-7.0%	8
低波動度	-0.9%	-0.3%	2.2%	-0.4%	-0.1%	-1.4%	-1.4%	1.5%	-0.2%	4.0%	-3.0%	-1.2%	-0.05%	1.2%	1.2%	7

累積超額報酬率圖(2021/12/31-2023/12/29)

本月





MAIN CONTENT

元大債券ETF殖利率統計表

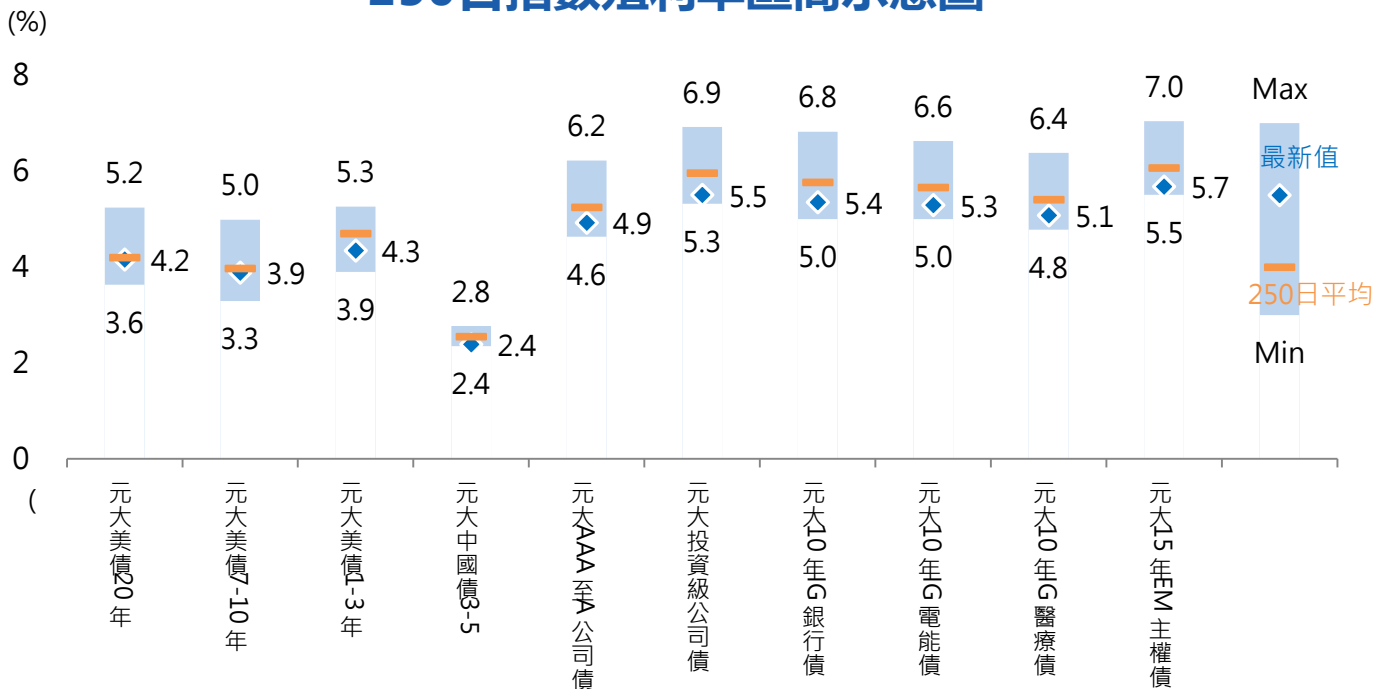
指數殖利率變動率(BP)

	最新值	1D	1W	1M	3M	MTD	YTD
00679B	4.16	5.5	-1.6	-36.2	-66.6	-46.9	8.7
00697B	3.89	3.8	-1.4	-35.8	-70.4	-47.0	6.2
00719B	4.34	-2.9	-2.0	-39.6	-80.2	-41.3	-14.0
00721B	2.39	-0.8	-7.6	-15.9	-11.0	-15.3	-27.1
00751B	4.93	2.4	-6.0	-42.2	-84.1	-47.2	-22.4
00720B	5.51	2.6	-7.4	-47.6	-93.9	-52.1	-41.0
00786B	5.36	3.6	-3.5	-48.0	-98.4	-51.4	-44.8
00787B	5.30	3.6	-1.6	-53.5	-87.7	-56.6	-25.3
00788B	5.08	2.1	-3.9	-44.0	-82.7	-50.5	-27.1
00870B	5.68	0.9	-3.3	-57.3	-95.5	-59.4	-27.0

資料來源：彭博，元大投信整理，資料截止日：2024/12/29

註：殖利率是以各檔ETF的標的指數殖利率進行計算，並未扣除產品費用率及手續費等。以上僅為歷史資料，不代表實際報酬率及未來績效保證，不同時間其結果亦可能不同，以上資料僅供參考。

250日指數殖利率區間示意圖



資料來源：彭博，元大投信整理，資料截止日：2024/12/29

註：殖利率是以各檔ETF的標的指數殖利率進行計算，並未扣除產品費用率及手續費等。以上僅為歷史資料，不代表實際報酬率及未來績效保證，不同時間其結果亦可能不同，以上資料僅供參考。



MAIN CONTENT

元大債券ETF殖利率統計表

指數信用利差變動率(BP)

		信用利差變動率(BP)					
	最新值	1D	1W	1M	3M	MTD	YTD
00751B	83.0	1.0	1.0	1.0	-14.0	5.0	-29.0
00720B	141.0	2.0	0.0	-3.0	-22.0	1.0	-46.0
00786B	127.8	0.6	1.3	-1.4	-24.5	2.5	-44.9
00787B	121.0	0.8	2.7	-9.1	-16.1	-5.1	-26.2
00788B	99.1	-0.9	0.4	1.1	-10.5	1.7	-28.0
00870B	155.0	-4.0	-1.0	-16.0	-28.0	-10.0	-36.0

資料來源：彭博，元大投信整理，資料截止日：2024/12/29

註：殖利率是以各檔ETF的標的指數殖利率進行計算，並未扣除產品費用率及手續費等。以上僅為歷史資料，不代表實際報酬率及未來績效保證，不同時間其結果亦可能不同，以上資料僅供參考。

指數特徵值

	指數殖利率(%)	指數票息率(%)	指數修正存續期間	指數加權平均信評
00679B	4.2	2.68	17.1	AAA
00697B	3.9	2.58	7.4	AAA
00719B	4.3	2.38	1.8	AAA
00721B	2.4	3.16	3.6	A+
00751B	4.9	3.96	15.4	A+
00720B	5.5	4.52	14.3	BBB
00786B	5.4	4.70	12.0	BBB+
00787B	5.3	4.50	13.4	A-
00788B	5.1	4.34	13.2	A
00870B	5.7	4.72	13.5	BBB1

資料來源：彭博，元大投信整理，資料截止日：2024/12/29

註：殖利率是以各檔ETF的標的指數殖利率進行計算，並未扣除產品費用率及手續費等。以上僅為歷史資料，不代表實際報酬率及未來績效保證，不同時間其結果亦可能不同，以上資料僅供參考。

更多ETF投資訊息



元大投信ETF專區



ETF-AI 智能投資平台



ID：元大投信



ID：yuantafunds

本報告純屬研究性質，不保證其完整性及精確性，且不提供或嘗試遊說客戶做為買賣股票之投資依據。報告中所有相關數據，係取自本公司相信為可靠之資料來源，且為特定日期所為之判斷，有其時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。投資人於決策時應審慎衡量本身風險，並就投資結果自行負責。以上報告，禁止任何形式之抄襲、引用或轉載。

台北總公司：106台北市大安區敦化南路二段69號18樓及67號B1 (02)2717-5555 109年金管投信新字第012號

台中分公司：406 台中市崇德路二段46之4號5樓 (04)2232-7878 111年金管投信新分字第002號



基金經理人

程惇亞



JasonCheng20@yuanta.com

基金警語

【元大投信獨立經營管理】

元大系列基金經金管會核准或同意生效，惟不表示絕無風險。本公司以往之經理績效，不保證系列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，不負責系列基金之盈虧，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。定期定額報酬率將因投資人不同時間進場，而有不同之投資績效，過去之績效亦不代表未來績效之保證；本文提及之經濟走勢預測，不必然代表基金之績效，基金投資風險請詳閱基金公開說明書。為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理及交易成本增加，進而損及基金長期持有之受益人權益，基金不歡迎受益人進行短線交易。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。

元大系列基金的運用限制、投資風險、配息機制、基金申購手續費之收取方式和比率、投資人應直接或間接負擔之相關費用、紛爭處理及申訴管道等皆已揭露於基金公開說明書中，投資人可向本公司及基金之銷售機構索取，亦可至公開資訊觀測站(<http://mops.twse.com.tw>)或本公司網站(<http://www.yuantafunds.com>)中查詢。

元大證券投資信託股份有限公司

台北總公司：106台北市大安區敦化南路二段69號18樓及67號地下一層 (02)2717-5555 109年金管投信新字第012號

台中分公司：406台中市北屯區崇德路二段46-4號5樓 (04)2232-7878 111年金管投信新分字第002號

兼營投顧核准文號：96年7月30日金管證四字第0960039848號函

客服專線：0800-009-968 (02)8770-7703

基金警語

【元大台灣高股息低波動ETF基金(本基金之配息來源可能為收益平準金)】

(一) 本基金經金融監督管理委員會核准或同意生效，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本基金公開說明書。(二) 本公開說明書之內容如有虛偽或隱匿之情事者，應由本證券投資信託事業及負責人與其他曾在公開說明書上簽章者依法負責。(三) 投資人交易本基金前，應再特別注意下列事項：1、本基金之操作目標為追蹤標的指數(即臺灣指數公司特選高股息低波動指數，簡稱特選高息低波指數)相關之報酬，而標的指數成分股票價格波動(包括但不限於受利多、利空或除息等因素影響)將影響標的指數的走勢，然本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。2、本基金雖以追蹤標的指數為操作目標，然下列因素仍可能使本基金報酬偏離標的指數報酬，且偏離方向無法預估：(1) 本基金可能因應申贖或維持所需曝險比例等因素而需每日進行基金曝險調整，故基金淨值將受到每日所交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費等)、投資組合成分價格波動或基金整體曝險比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。(2) 本基金投資組合與標的指數相關性將受到基金持有之有價證券或期貨與標的指數之相關性等因素影響。此外，基金投資組合中持有的期貨部位，因期貨的價格發現功能使其對市場信息、多空走勢之價格反應可能不同於股票，因此當市場出現特定信息時，基金淨值將同時承受期貨及股票對市場信息反應不一所產生的價格波動影響，可能使本基金報酬將與投資目標產生偏離。有關本基金投資策略請詳見本基金公開說明書【基金概況】/壹、基金簡介/十、投資策略及特色之重點摘述之說明。(四) 本基金之投資風險包括但不限於上述第(三)項內容，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。有關本基金運用之限制及投資風險之揭露請詳見第14頁至第15頁及第23頁至第29頁。(五) 「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。本基金配息可能由基金的收益平準金中支付。任何涉及由收益平準金支出的部份，可能導致原始投資金額減損。(六) 本基金收益分配頻率之調整自111年7月29日起生效，並自111年9月19日施行，由年度收益分配變更為每季收益分配。(七) 本基金自成立日起，即運用本基金資產進行投資組合佈局，本基金投資組合成分價格波動會影響本基金淨值表現。投資人於本基金成立日(不含當日)前參與申購所買入的本基金每受益權單位之發行價格(即新臺幣參拾元)，不等同於本基金掛牌上市之價格，參與申購投資人需自行承擔本基金成立日起至掛牌日止期間之本基金淨資產價格波動所產生折/溢價的風險。本基金上市日前(不含當日)，經理公司不接受基金受益權單位數之買回。本基金受益憑證上市後之買賣成交價格依臺灣證券交易所所有關規定辦理。(八) 本基金自上市日(含當日)起之申購，經理公司將依本公開說明書規定依本基金「現金申購/買回日清單公告」所載之「每申購/買回基數約當市值」加計110s%向申購人預收申購價金。(九) 指數免責聲明：「臺灣指數公司特選高股息低波動指數」係由臺灣指數股份有限公司編製及計算；惟「基金」並非由臺灣指數股份有限公司贊助、認可、銷售或推廣，且臺灣指數股份有限公司不就使用「臺灣指數公司特選高股息低波動指數」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。

基金警語

【元大美國政府20年期(以上)債券基金(本基金之配息來源可能為收益平準金)】

本基金經金融監督管理委員會同意生效，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本基金公開說明書。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，基金投資風險請詳閱基金公開說明書。有關各子基金應負擔之相關費用，已揭露於基金公開說明書中，投資人可向本公司及基金之銷售機構索取，或至公開資訊觀測站及本公司網站(www.yuantafunds.com)中查詢。本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。本基金配息可能由基金的收益平準金中支付。任何涉及由收益平準金支出的部份，可能導致原始投資金額減損。**為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理費及交易成本增加，進而損及基金長期持有之受益人權益，本基金不歡迎受益人進行短線交易。**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。有關各子基金之特性、投資人應負擔之成本費用及相關投資風險等資訊，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。各子基金之操作目標均在追蹤與ICE美國政府20+年期債券指數相關之報酬，而標的指數成分債券價格波動(包括但不限於受利多、利空、債券交易市場流動性不足、交易對手之信用風險、利率風險等因素影響)將影響各子基金標的指數的走勢，然各子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。各子基金資產將分別主要投資於與標的指數相關之有價證券及證券相關商品，投資人交易各子基金除需承擔匯率波動風險外，應特別注意因時差關係標的指數成分國家之證券市場交易時間與臺灣證券市場交易時間可能僅部份重疊或完全無重疊，因此各子基金集中市場交易可能無法完全即時反應標的指數之價格波動風險。各子基金上市日或上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受各子基金受益權單位數之買回。投資人於各子基金成立日(不含當日)前參與申購所買入的各子基金每受益權單位之發行價格，不等同於各子基金掛牌上市或上櫃之價格，參與申購投資人需自行承擔各子基金成立日起自掛牌日止期間之各子基金淨資產價格波動所產生折/溢價的風險。各子基金受益憑證上市或上櫃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。各子基金上市日後將依臺灣證券交易所或證券櫃檯買賣中心規定於臺灣證券交易所時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。各子基金之淨值以新臺幣計價，而基金主要投資標的為美國政府公債或期貨，因此匯率波動會影響各子基金淨值之計算。而計算盤中估計淨值所使用的盤中即時匯率與價格，因評價時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算之匯率及價格亦有差異。此外，由於臺灣證券交易所與美國證券交易所因時差關係無重疊的交易時間，故各子基金交易部位及淨值須於交易後次一營業日確認及計算，因此計算盤中估計淨值與實際基金淨值計算之基金投組或有差異，投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易所時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。除臺灣證交所另有規定者外，首次買賣槓桿反向指數股票型基金受益憑證者，應符合「臺灣證券交易所股份有限公司受益憑證買賣辦法」所訂定之投資人適格條件，並應簽具與臺灣證交所訂定內容相符之風險預告書，經理公司、基金銷售機構或參與證券商始得接受其交易。投資人適格條件如下之一：1、已開立信用交易帳戶；2、最近一年內委託買賣認購(售)權證成交達十筆(含)以上；3、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。【指數免責聲明】元大美國政府20年期(以上)債券基金、元大美國政府20年期(以上)債券單日正向2倍基金及元大美國政府20年期(以上)債券單日反向1倍基金(以下統稱「系列基金」)係分別以「ICE美國政府20+年期債券指數」(ICE U.S. Treasury 20+ Year Bond Index)、「ICE美國政府20+年期債券2倍槓桿指數」(ICE U.S. Treasury 20+ Year Bond 2X Leveraged Index)及「ICE美國政府20+年期債券1倍反向指數」(ICE U.S. Treasury 20+ Year Bond 1X Inverse Index)(以下統稱「系列指數」)之全部或部分為基礎。該系列指數係由Intercontinental Exchange, Inc.或其關係企業所擁有，且已由Intercontinental Exchange, Inc.之關係企業Interactive Data Pricing and Reference Data, LLC(以下簡稱「Interactive Data」)授權予元大投信使用。系列指數為Intercontinental Exchange, Inc.與其關係企業之商標，並須經授權才可使用。系列指數係由Interactive Data及/或其關係企業所維護。Interactive Data與元大投信或其關係企業並無附屬關係。元大投信已與Interactive Data就使用系列指數簽署授權契約。元大投信或系列基金並非由Interactive Data資助、擔保、分銷或推廣，且Interactive Data對元大投信、系列基金或系列基金追蹤指數之能力不作出任何聲明及保證。Interactive Data對系列指數及其包含之資料於特定目的之適銷性或適合性不作任何明示或暗示的保證，且排除任何的保證。Interactive Data在任何情況下均不對任何特殊的、懲罰性的、直接或間接的或衍生的損害或損失(包括利潤損失)承擔任何責任，即使Interactive Data已告知該等損失或損害發生的可能性亦同。

基金警語

【元大美國政府7至10年期債券基金】

本基金經金融監督管理委員會同意生效，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本基金公開說明書。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，基金投資風險請詳閱基金公開說明書。有關各子基金應負擔之相關費用，已揭露於基金公開說明書中，投資人可向本公司及基金之銷售機構索取，或至公開資訊觀測站及本公司網站(www.yuantafunds.com)中查詢。為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理及交易成本增加，進而損及基金長期持有之受益人權益，本基金不歡迎受益人進行短線交易。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。本子基金係採用指數化策略，以追蹤標的指數(即「ICE美國政府7-10年期債券2倍槓桿指數、ICE美國政府7-10年期債券1倍反向指數」)之報酬表現為投資目標，基金具有槓桿操作風險，其投資盈虧深受市場波動與複利效果影響，與傳統指數股票型基金不同，故不適合追求長期投資且不熟悉本子基金以追求單日報酬為投資目標之投資人。投資人交易前，應詳閱本傘型基金公開說明書並確定已充分瞭解本子基金之風險及特性。本子基金之標的指數-「ICE美國政府7-10年期債券2倍槓桿指數、ICE美國政府7-10年期債券1倍反向指數」係基於「ICE美國政府7-10年期債券指數」的單日報酬所編製及計算，以反應「ICE美國政府7-10年期債券指數」之單日正向2倍報酬表現及單日反向1倍報酬表現。「ICE美國政府7-10年期債券2倍槓桿指數」之計算因受到累積報酬之複利效果影響，故連續兩日以上及長期之累積報酬率會偏離同期間「ICE美國政府7-10年期債券指數」之累積報酬，且偏離方向無法預估，故標的指數報酬所對應「ICE美國政府7-10年期債券指數」正向2倍報酬及「ICE美國政府7-10年期債券指數」反向1倍報酬僅限於單日，即本子基金所追求之正向2倍報酬、反向1倍報酬皆以標的指數單日報酬為限。因此，投資人長期持有本子基金之投資報酬可能會與同期間「ICE美國政府7-10年期債券指數」之正向2倍報酬及反向1倍報酬產生偏離。有關計算累積報酬之複利效果之說明請詳本基金公開說明書。本子基金為達到追蹤標的指數報酬之目標，正向2倍報酬投資組合整體曝險部位將盡可能維持在基金淨資產價值200%之水位，反向1倍報酬投資組合整體曝險部位將盡可能維持在基金淨資產價值100%之水位故本子基金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。各子基金之操作目標均在追蹤與ICE美國政府7-10年期債券指數相關之報酬，而ICE美國政府7-10年期債券指數成分債券價格波動(包括但不限於受利多、利空、債券交易市場流動性不足、交易對手之信用風險、利率風險等因素影響)將影響各子基金標的指數的走勢，然各子基金追求標的指數報酬之目標，不隨標的指數劇烈波動而改變。各子基金為指數股票型基金，基金核准成立後將向臺灣證券交易所股份有限公司(以下簡稱臺灣證交所)與財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱證券櫃檯買賣中心)申請上市或上櫃交易，各子基金資產將主要投資於與ICE美國政府7-10年期債券指數相關之有價證券及證券相關商品，投資人交易各子基金除需承擔匯率波動風險外，應特別注意雖然債券市場得24小時進行交易，但各子基金交易其他美國有價證券或美債期貨之時間與臺灣證券交易所市場因時差關係故無重疊之交易時間，因此各子基金集中市場交易可能有無法即時完全反應基金投資組合之價格波動風險。各子基金雖以追蹤標的指數為操作目標，然下列因素仍可能使各子基金報酬偏離標的指數報酬，且偏離方向無法預估：(1)各子基金可能因應申贖或維持所需曝險比例等因素而需每日進行基金曝險調整，故基金淨值將受到每日所交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費、上市或上櫃費等)、投資組合成分價格波動或基金整體曝險比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。(2)各子基金投資組合與標的指數相關性將受到基金持有之有價證券或期貨與標的指數或ICE美國政府7-10年期債券指數之相關性等因素影響。此外，基金投資組合中持有的期貨部位，因期貨的價格發現功能使其對市場信息、多空走勢之價格反應可能不同於債券，因此當市場出現特定信息時，基金淨值將同時承受期貨及債券對市場信息反應不一所產生的價格波動影響，可能使各子基金報酬將與投資目標產生偏離。有關各子基金投資策略請詳見本傘型基金說明書說明。(3)各子基金均以新臺幣計價，而各子基金所投資的有價證券或期貨標的可能為新臺幣以外之計價貨幣，因此各子基金承受相關匯率波動風險可能使各子基金報酬與投資目標產生偏離。各子基金上市日或上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受各子基金受益權單位數之買回。投資人於各子基金成立日(不含當日)前參與申購所買入的各子基金每受益權單位之發行價格，不同於各子基金掛牌上市或上櫃之價格，參與申購投資人需自行承擔各子基金成立日起自掛牌日止期間之各子基金淨資產價格波動所產生折/溢價的風險。各子基金受益憑證上市或上櫃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關規定辦理。各子基金上市日或上櫃日後將依臺灣證券交易所或證券櫃檯買賣中心規定於臺灣證券交易所時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。各子基金之淨值以新臺幣計價，而基金主要投資標的為美國政府公債或期貨，因此匯率波動會影響各子基金淨值之計算。而計算盤中估計淨值所使用的盤中即時匯率與價格，因評價時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算之匯率及價格亦有差異。此外，由於臺灣證券交易所時間與美國證券交易所時間因時差關係無重疊的交易時間，故各子基金交易部位及淨值須於交易後次一營業日確認及計算，因此計算盤中估計淨值與實際基金淨值計算之基金投組或有差異，投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易所時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。除臺灣證交所另有規定者外，首次買賣槓桿反向指數股票型基金受益憑證者，應符合「臺灣證券交易所股份有限公司受益憑證買賣辦法」所訂定之投資人適格條件，並應簽具與臺灣證交所訂定內容相符之風險預告書，經理公司、基金銷售機構或參與證券商始得接受其交易。投資人適格條件如下之一：1、已開立信用交易帳戶；2、最近一年內委託買賣認購(售)權證成交達十筆(含)以上；3、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。

基金警語

【元大美國政府1至3年期債券ETF基金】

本基金經金管會核准或同意生效，惟不表示絕無風險。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，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，基金投資風險請詳閱基金公開說明書。有關基金應負擔之相關費用，已揭露於基金公開說明書中，投資人可向本公司及基金之銷售機構索取，或至公開資訊觀測站及本公司網站(www.yuantafunds.com)中查詢。為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理及交易成本增加，進而損及基金長期持有之受益人權益，本基金不歡迎受益人進行短線交易。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。投資人交易本傘型基金之子基金元大美國政府1至3年期債券ETF基金前，應再特別注意下列事項：1. 該子基金之操作目標在追蹤與標的指數相關之報酬(標的指數為ICE美國政府1-3年期債券指數)，而標的成分債券價格波動(包括但不限於受利多、利空、債券交易市場流動性不足、交易對手之信用風險、利率風險等因素影響)將影響標的指數的走勢，然追求標的指數報酬之目標，不因標的指數劇烈波動而改變。2. 雖以追蹤標的指數為操作目標，然下列因素仍可能使各子基金報酬偏離標的指數報酬，且偏離方向無法預估：(1)可能因應申贖或維持所需曝險比例等因素而需每日進行基金曝險調整，故基金淨值將受到每日所交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費、上櫃費等)、投資組合成分價格波動或基金整體曝險比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。(2)投資組合與標的指數相關性將受到基金持有之有價證券或期貨與標的指數之相關性等因素影響。此外，基金投資組合中持有的期貨部位，因期貨的價格發現功能使其對市場信息、多空走勢之價格反應可能不同於債券，因此當市場出現特定信息時，基金淨值將同時承受期貨及債券對市場信息反應不一所產生的價格波動影響，可能使報酬將與投資目標產生偏離。有關投資策略請詳見本傘型基金說明書【基金概況】/壹、基金簡介/十、投資策略及特色之重點摘述之說明。(3)均以新臺幣計價，而所投資的有價證券或期貨標的可能為新臺幣以外之計價貨幣，因此承受相關匯率波動風險可能使報酬與投資目標產生偏離。投資人於成立日(不含當日)前參與申購所買入的每受益權單位之發行價格，不等同於掛牌上櫃之價格，參與申購投資人需自行承擔成立日起自掛牌日止期間之淨資產價格波動所產生折/溢價的風險。上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受受益權單位數之買回。受益憑證上櫃後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱證券櫃檯買賣中心)所有關規定辦理。3. 於上櫃日後將依證券櫃檯買賣中心所規定於臺灣證券交易時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。淨值以新臺幣計價而基金主要投資標的為債券或期貨，因此匯率波動會影響淨值之計算，而計算盤中估計淨值所使用的盤中即時匯率，因評價時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算之匯率或有差異，因此計算盤中估計淨值與實際基金淨值計算之基金投組或有差異，投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。元大美國政府1至3年期債券ETF證券投資信託基金係以「ICE美國政府1-3年期債券指數」(ICE U.S. Treasury 1-3 Year Bond Index)之全部或部分為基礎。該指數係由ICE Data Indices, LLC或其關係企業所擁有，且已由ICE Data Indices, LLC授權予元大投信使用。指數為ICE Data Indices, LLC與其關係企業之商標，並須經授權才可使用。指數係由ICE Data Indices, LLC及/或其關係企業所維護。ICE Data Indices, LLC與元大投信或其關係企業並無附屬關係。元大投信已與ICE Data Indices, LLC就使用指數簽署授權契約。元大投信或元大美國政府1至3年期債券ETF證券投資信託基金並非由ICE Data Indices, LLC資助、擔保、分銷或推廣，且ICE Data Indices, LLC對元大投信、元大美國政府1至3年期債券ETF證券投資信託基金或追蹤指數之能力不作出任何聲明及保證。ICE Data Indices, LLC對ICE美國政府1-3年期債券指數及其包含之資料於特定目的之適銷性或適合性不作任何明示或暗示的保證，且排除任何的保證。ICE Data Indices, LLC在任何情況下均不對任何的、懲罰性的、直接或間接的或衍生的損害或損失(包括利潤損失)承擔任何責任，即使ICE Data Indices, LLC已告知該等損失或損害發生的可能性亦同。ICE Data Indices, LLC不負責也不參與金融商品發行時機、價格、數量的決定。ICE Data Indices, LLC不負責金融商品定價、買賣或贖回的公式計算與決策。ICE Data Indices, LLC並非投資顧問。指數中包含的標的並非代表ICE Data Indices, LLC推薦買賣或持有，也不作為投資建議。指數過去表現不代表未來表現。指數由ICE Data Indices, LLC編輯與計算，編輯與計算過程中，ICE Data Indices, LLC沒有義務納入被授權人或持有人的需求。以上聲明如有與英文版差異，以英文版為準。

基金警語

【元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金(本基金之配息來源可能為收益平準金)】

本基金經金管會核准或同意生效，惟不表示絕無風險。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，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，基金投資風險請詳閱基金公開說明書。有關基金應負擔之相關費用，已揭露於基金公開說明書中，投資人可向本公司及基金之銷售機構索取，或至公開資訊觀測站及本公司網站(www.yuantafunds.com)中查詢。本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。本基金配息可能由基金的收益平準金中支付。任何涉及由收益平準金支出的部份，可能導致原始投資金額減損。為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理及交易成本增加，進而損及基金長期持有之受益人權益，本基金不歡迎受益人進行短線交易。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。投資人交易本傘型基金之子基金元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金前，應再特別注意下列事項：1.該子基金之操作目標在追蹤與標的指數相關之報酬(標的指數為彭博美國20+年期BBB公司債流動性指數)，而標的成分債券價格波動(包括但不限於受利多、利空、債券交易市場流動性不足、交易對手之信用風險、利率風險等因素影響)將影響標的指數的走勢，然追求標的指數報酬之目標，不因標的指數劇烈波動而改變。2、雖以追蹤標的指數為操作目標，然下列因素仍可能使各子基金報酬偏離標的指數報酬，且偏離方向無法預估：(1)可能因應申贖或維持所需曝險比例等因素而需每日進行基金曝險調整，故基金淨值將受到每日所交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費、上櫃費等)、投資組合成分價格波動或基金整體曝險比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。(2)投資組合與標的指數相關性將受到基金持有之有價證券或期貨與標的指數之相關性等因素影響。此外，基金投資組合中持有的期貨部位，因期貨的價格發現功能使其對市場信息、多空走勢之價格反應可能不同於債券，因此當市場出現特定信息時，基金淨值將同時承受期貨及債券對市場信息反應不一所產生的價格波動影響，可能使報酬將與投資目標產生偏離。有關投資策略請詳見本傘型基金說明書【基金概況】/壹、基金簡介/十、投資策略及特色之重點摘述之說明。(3)均以新臺幣計價，而所投資的有價證券或期貨標的可能為新臺幣以外之計價貨幣，因此承受相關匯率波動風險可能使報酬與投資目標產生偏離。投資人於成立日(不含當日)前參與申購所買入的每受益權單位之發行價格，不同於掛牌上櫃之價格，參與申購投資人需自行承擔成立日起自掛牌日止期間之淨資產價格波動所產生折/溢價的風險。上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受受益權單位數之買回。受益憑證上櫃後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱證券櫃檯買賣中心)所有關規定辦理。3.於上櫃日後將依證券櫃檯買賣中心所規定於臺灣證券交易時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。淨值以新臺幣計價而基金主要投資標的為債券或期貨，因此匯率波動會影響淨值之計算，而計算盤中估計淨值所使用的盤中即時匯率，因評價時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算之匯率或有差異，因此計算盤中估計淨值與實際基金淨值計算之基金投組或有差異，投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。【指數免責聲明】「彭博®」及「彭博美國20+年期BBB公司債流動性指數」為Bloomberg Finance L.P.及其關係企業(包括指數管理公司—彭博指數服務有限公司(「BISL」))(統稱「彭博」)的服務商標，且已授權由元大投信用於若干用途。彭博並未贊助、認可、銷售或推廣元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金。彭博未向元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金所有人或對手方或任何公眾就一般投資於證券或特別投資於元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金的適用性作出任何明示或暗示之聲明或保證。彭博與元大投信之間的唯一關係為向其授出若干商標、商號名稱及服務商標，以及「彭博美國20+年期BBB公司債流動性指數」的許可，而該指數由BISL在不考慮元大投信或「彭博美國20+年期BBB公司債流動性指數」的情況下予以確定、構建及計算。彭博於確定、構建或計算「彭博美國20+年期BBB公司債流動性指數」時無義務考慮元大投信或元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金所有人的需求。彭博無責且未參與決定元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金之發行時間、價格或數量。彭博對元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金客戶不承擔任何義務或責任，包括但不限於與元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金管理、行銷或交易相關之義務或責任。彭博概不保證「彭博美國20+年期BBB公司債流動性指數」或其任何相關資料的準確性及/或完整性，且無須就其中的任何錯誤、遺漏或中斷承擔責任。彭博不對元大投信、元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金所有人或任何其他人士或實體使用「彭博美國20+年期BBB公司債流動性指數」或其任何相關資料所獲得的結果作出任何明示或暗示之保證。彭博不對「彭博美國20+年期BBB公司債流動性指數」或其任何相關資料作出任何明示或暗示之保證，且明確豁免關於其適銷性或適合於特定目或用途的適宜性的任何保證。在不限制上述任何條文的情況下，在法律許可的最大範圍內，彭博、其授權人及其各自的僱員、承包商、代理商、供應商和經銷商不對與元大20年期以上BBB級美元公司債券ETF基金或「彭博美國20+年期BBB公司債流動性指數」或任何與其相關之資料或數值有關的任何傷害或損害(無論是直接、間接、衍生、偶然、懲罰性或以其他方式)承擔任何責任或義務，無論是因其疏忽或其他原因所引起，即使已告知其發生損害之可能性。

基金警語

【元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金】

本基金經金管會核准或同意生效，惟不表示絕無風險。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，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，基金投資風險請詳閱基金公開說明書。有關基金應負擔之相關費用，已揭露於基金公開說明書中，投資人可向本公司及基金之銷售機構索取，或至公開資訊觀測站及本公司網站(www.yuantafunds.com)中查詢。為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理及交易成本增加，進而損及基金長期持有之受益人權益，本基金不歡迎受益人進行短線交易。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。投資人交易本傘型基金之子基金元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金前，應再特別注意下列事項：1該子基金之操作目標在追蹤與標的指數相關之報酬(標的指數為彭博中國國債及政策性金融債3-5年期債券指數)，而標的成分債券價格波動(包括但不限於受利多、利空、債券交易市場流動性不足、交易對手之信用風險、利率風險等因素影響)將影響標的指數的走勢，然追求標的指數報酬之目標，不因標的指數劇烈波動而改變。2、雖以追蹤標的指數為操作目標，然下列因素仍可能使各子基金報酬偏離標的指數報酬，且偏離方向無法預估：(1)可能因應申贖或維持所需曝險比例等因素而需每日進行基金曝險調整，故基金淨值將受到每日所交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費、上櫃費等)、投資組合成分價格波動或基金整體曝險比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。(2)投資組合與標的指數相關性將受到基金持有之有價證券或期貨與標的指數之相關性等因素影響。此外，基金投資組合中持有的期貨部位，因期貨的價格發現功能使其對市場信息、多空走勢之價格反應可能不同於債券，因此當市場出現特定信息時，基金淨值將同時承受期貨及債券對市場信息反應不一所產生的價格波動影響，可能使報酬將與投資目標產生偏離。有關投資策略請詳見本傘型基金說明書【基金概況】/壹、基金簡介/十、投資策略及特色之重點摘述之說明。(3)均以新臺幣計價，而所投資的有價證券或期貨標的可能為新臺幣以外之計價貨幣，因此承受相關匯率波動風險可能使報酬與投資目標產生偏離。投資人於成立日(不含當日)前參與申購所買入的每受益權單位之發行價格，不同於掛牌上櫃之價格，參與申購投資人需自行承擔成立日起自掛牌日止期間之淨資產價格波動所產生折/溢價的風險。上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受受益權單位數之買回。受益憑證上櫃後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱證券櫃檯買賣中心)所有關規定辦理。3.於上櫃日後將依證券櫃檯買賣中心所規定於臺灣證券交易時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。淨值以新臺幣計價而基金主要投資標的為債券或期貨，因此匯率波動會影響淨值之計算，而計算盤中估計淨值所使用的盤中即時匯率，因評價時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算之匯率或有差異，因此計算盤中估計淨值與實際基金淨值計算之基金投組或有差異，投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。【指數免責聲明】「彭博®」及「彭博中國國債及政策性金融債3-5年期債券指數」為Bloomberg Finance L.P.及其關係企業(包括指數管理公司—彭博指數服務有限公司(「BISL」))(統稱「彭博」)的服務商標，且已授權由元大投信用於若干用途。彭博並未贊助、認可、銷售或推廣元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金。彭博未向元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金所有人或對手方或任何公眾就一般投資於證券或特別投資於元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金的適用性作出任何明示或暗示之聲明或保證。彭博與元大投信之間的唯一關係為向其授出若干商標、商號名稱及服務商標，以及「彭博中國國債及政策性金融債3-5年期債券指數」的許可，而該指數由BISL在不考慮元大投信或「彭博中國國債及政策性金融債3-5年期債券指數」的情況下予以確定、構建及計算。彭博於確定、構建或計算「彭博中國國債及政策性金融債3-5年期債券指數」時無義務考慮元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金所有人的需求。彭博無責且未參與決定元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金之發行時間、價格或數量。彭博對元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金客戶不承擔任何義務或責任，包括但不限於與元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金管理、行銷或交易相關之義務或責任。彭博概不保證「彭博中國國債及政策性金融債3-5年期債券指數」或其任何相關資料的準確性及/或完整性，且無須就其中的任何錯誤、遺漏或中斷承擔責任。彭博不對元大投信、元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金所有人或任何其他人士或實體使用「彭博中國國債及政策性金融債3-5年期債券指數」或其任何相關資料所獲得的結果作出任何明示或暗示之保證。彭博不對「彭博中國國債及政策性金融債3-5年期債券指數」或其任何相關資料作出任何明示或暗示之保證，且明確豁免關於其適銷性或適合於特定目或用途的適宜性的任何保證。在不限制上述任何條文的情況下，在法律許可的最大範圍內，彭博、其授權人及其各自的僱員、承包商、代理商、供應商和經銷商不對與元大中國國債及政策性金融債3至5年期債券ETF基金或「彭博中國國債及政策性金融債3-5年期債券指數」或任何與其相關之資料或數值有關的任何傷害或損害(無論是直接、間接、衍生、偶然、懲罰性或以其他方式)承擔任何責任或義務，無論是因其疏忽或其他原因所引起，即使已告知其發生損害之可能性。

基金警語

【元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金(本基金之配息來源可能為收益平準金)】

本基金經金融監督管理委員會核准或同意生效，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，投資人申購前應詳閱本基金公開說明書。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，基金投資風險請詳閱基金公開說明書。有關本基金應負擔之相關費用，已揭露於基金公開說明書中，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(mops.twse.com.tw)及本公司網站(www.yuantafunds.com)中查詢。本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。本基金配息可能由基金的收益平準金中支付。任何涉及由收益平準金支出的部份，可能導致原始投資金額減損。為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理及交易成本增加，進而損及基金長期持有之受益人權益，本基金不歡迎受益人進行短線交易。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。本基金之操作目標在追蹤彭博美國20+年期AAA-A公司債流動性指數(即標的指數)相關之報酬，而標的成分債券價格波動(包括但不限於受利多、利空、債券交易市場流動性不足、交易對手之信用風險、利率風險等因素影響)將影響基金標的指數的走勢，然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。本基金雖以追蹤標的指數為操作目標，惟可能因包括但不限於基金持有有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用、投資組合成分價格波動或基金整體曝險比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離，且偏離方向無法預估。投資人於本基金成立日(不含當日)前參與申購所買入的本基金每受益權單位之發行價格(即新臺幣肆拾元)，不等同於本基金掛牌上櫃之價格，參與申購投資人需自行承擔本基金自成立日起至掛牌日止期間之本基金淨資產價格波動所產生折/溢價的風險。本基金上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受本基金受益權單位數之買回。本基金受益憑證上櫃後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心所有關規定辦理。本基金於上櫃日後將依證券櫃檯買賣中心所規定於臺灣證券交易時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。【指數免責聲明】「彭博®」及「彭博美國20+年期AAA-A公司債流動性指數」為Bloomberg Finance L.P.及其關係企業(包括指數管理公司—彭博指數服務有限公司(「BISL」)(統稱「彭博」)的服務商標，且已授權由元大投信用於若干用途。彭博並未贊助、認可、銷售或推廣本元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金。彭博未向本元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金所有人或對手方或任何公眾就一般投資於證券或特別投資於本元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金的適用性作出任何明示或暗示之聲明或保證。彭博與元大投信之間的唯一關係為向其授出若干商標、商號名稱及服務商標，以及彭博美國20+年期AAA-A公司債流動性指數的許可，而該指數由BISL在不考慮元大投信或元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金的情況下予以確定、構建及計算。彭博於確定、構建或計算彭博美國20+年期AAA-A公司債流動性指數時無義務考慮元大投信或元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金所有人的需求。彭博無責且未參與決定元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金之發行時間、價格或數量。彭博對元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金客戶不承擔任何義務或責任，包括但不限於與元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金管理、行銷或交易相關之義務或責任。彭博概不保證彭博美國20+年期AAA-A公司債流動性指數或其任何相關資料的準確性及/或完整性，且無須就其中的任何錯誤、遺漏或中斷承擔責任。彭博不對元大投信、元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金所有人或任何其他人士或實體使用彭博美國20+年期AAA-A公司債流動性指數或其任何相關資料所獲得的結果作出任何明示或暗示之保證。彭博不對彭博美國20+年期AAA-A公司債流動性指數或其任何相關資料作出任何明示或暗示之保證，且明確豁免關於其適銷性或適合於特定目或用途的適宜性的任何保證。在不限上述任何條文的情況下，在法律許可的最大範圍內，彭博、其授權人及其各自的僱員、承包商、代理商、供應商和經銷商不對與元大20年期以上AAA至A級美元公司債券ETF基金或彭博美國20+年期AAA-A公司債流動性指數或任何與其相關之資料或數值有關的任何傷害或損害(無論是直接、間接、衍生、偶然、懲罰性或以其他方式)承擔任何責任或義務，無論是因其疏忽或其他原因所引起，即使已告知其發生損害之可能性。

基金警語

【元大10年期以上美元投資級醫療保健債券ETF基金】、【元大10年期以上美元投資級公共事業電能債券ETF基金】、【元大10年期以上美元投資級銀行債券ETF基金】

本傘型基金之各子基金經金管會核准或同意生效，惟不表示絕無風險。本公司以往之經理績效，不保證本傘型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，不負責本傘型基金之盈虧，亦不保證最低之收益，定期定額報酬率將因投資人不同時間進場，而有不同之投資績效，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效及未來績效之保證，不同時間進行模擬操作，其結果亦可能不同。基金投資風險請詳閱基金公開說明書。基金申購手續費之收取方式，比率及投資人所需負責之直接或間接相關費用，已揭露於基金公開說明書中，投資人可向本公司及基金之銷售機構索取，或至公開資訊觀測站及本公司網站(www.yuantafunds.com)中查詢。為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理及交易成本增加，進而損及基金長期持有之受益人權益，本基金不歡迎受益人進行短線交易。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。投資人交易本傘型基金之三檔子基金前，應再特別注意下列事項：1、各子基金之操作目標在追蹤與標的指數相關之報酬(元大10年期以上美元投資級醫療保健債券ETF基金之標的指數為富時世界美元計價10年期以上投資級醫療保健債券指數；元大10年期以上美元投資級公共事業電能債券ETF基金之標的指數為富時世界美元計價10年期以上投資級公共事業電能債券指數；元大10年期以上美元投資級銀行債券ETF基金之標的指數為富時世界美元計價10年期以上投資級銀行債券指數)，而標的成分債券價格波動(包括但不限於受利多、利空、債券交易市場流動性不足、交易對手之信用風險、利率風險等因素影響)將影響各子基金標的指數的走勢，然各子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。2、各子基金雖以追蹤標的指數為操作目標，然下列因素仍可能使各子基金報酬偏離標的指數報酬，且偏離方向無法預估：(1)各子基金可能因應申贖或維持所需曝險比例等因素而需每日進行基金曝險調整，故基金淨值將受到每日所交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費、上櫃費等)、投資組成分價格波動或基金整體曝險比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。(2)各子基金投資組合與標的指數相關性將受到基金持有之有價證券或期貨與標的指數之相關性等因素影響。此外，基金投資組合中持有的期貨部位，因期貨的價格發現功能使其對市場信息、多空走勢之價格反應可能不同於債券，因此當市場出現特定信息時，基金淨值將同時承受期貨及債券對市場信息反應不一所產生的價格波動影響，可能使各子基金報酬將與投資目標產生偏離。有關各子基金投資策略請詳見本傘型基金公開說明書【基金概況】/壹、基金簡介/十、投資策略及特色之重點摘述之說明。(3)各子基金均以新臺幣計價，而各子基金所投資的有價證券或期貨標的可能為新臺幣以外之計價貨幣，因此各子基金承受相關匯率波動風險可能使各子基金報酬與投資目標產生偏離。各子基金之投資風險包括但不限於上述內容，投資人交易前，應詳閱本傘型基金公開說明書並確定已充分瞭解各子基金之風險及特性。有關各子基金運用之限制及投資風險之揭露請詳見公開說明書。各子基金自成立日起，即運用各子基金資產進行投資組合佈局，各子基金投資組成分價格波動會影響各子基金淨值表現。投資人於各子基金成立日(不含當日)前參與申購所買入的各子基金每受益權單位之發行價格，不等同於各子基金掛牌上櫃之價格，參與申購投資人需自行承擔各子基金成立日起至掛牌日止期間之各子基金淨資產價值波動所產生折/溢價的風險。各子基金上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受各子基金受益權單位數之買回。各子基金受益憑證上櫃後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱證券櫃檯買賣中心)所有關規定辦理。本傘型基金之各子基金於上櫃日後將依證券櫃檯買賣中心所規定於臺灣證券交易時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。各子基金淨值以新臺幣計價而基金主要投資標的為債券或期貨，因此匯率波動會影響各子基金淨值之計算，而計算盤中估計淨值所使用的盤中即時匯率，因評價時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算之匯率或有差異，因此計算盤中估計淨值與實際基金淨值計算之基金投組或有差異，投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。各子基金自上櫃日(含當日)起之申購，經理公司將依本傘型基金公開說明書規定依各子基金「現金申購/買回日清單公告」所載之「每申購/買回基數約當市值」加計108%，向申購人預收申購價金。惟如遇臺灣證券市場連續休假日之情事者，前述一定比例之比重得由經理公司公告後機動調整，並應於調整後三個營業日內恢復各子基金規定之比例。「元大10年期以上美元投資級銀行債券ETF基金」、「元大10年期以上美元投資級醫療保健債券ETF基金」、「元大10年期以上美元投資級公共事業電能債券ETF基金」由元大投信發行，與倫敦證券交易所集團公司及其旗下企業(統稱“LSE Group”)之間無關聯，也並無任何形式之贊助、背書、銷售或推廣。FTSE Russell是LSE Group公司之商號。「富時世界美元計價10年期以上投資級銀行債券指數」、「富時世界美元計價10年期以上投資級醫療保健債券指數」、「富時世界美元計價10年期以上投資級公共事業電能債券指數」的全部權利屬LSE Group 旗下持有該指數之富時固定收益有限公司(FTSE Fixed Income, LLC)所有。FTSE®為LSE Group之商標，並由其他LSE Group旗下公司根據授權使用。指數由FTSE Fixed Income, LLC或其關係企業、代理人、合作夥伴計算或代其計算。LSE Group概不就(a)使用、依賴指數資料或任何與指數相關之錯誤或(b)「元大10年期以上美元投資級銀行債券ETF基金」、「元大10年期以上美元投資級醫療保健債券ETF基金」、「元大10年期以上美元投資級公共事業電能債券ETF基金」之投資或營運對任何人士負法律責任。LSE Group概不就「元大10年期以上美元投資級銀行債券ETF基金」、「元大10年期以上美元投資級醫療保健債券ETF基金」、「元大10年期以上美元投資級公共事業電能債券ETF基金」所取得的績效或元大投信提出的指數作出聲明、預測、保證或陳述。

基金警語

【元大15年期以上新興市場主權債ETF基金(本基金有一定比重投資於非投資等級之高風險債券，且配息來源可能為收益平準金)】

元大新興債ETF傘型證券投資信託基金經金融監督管理委員會核准或申報生效，惟不表示各子基金絕無風險。本證券投資信託事業以往之經理績效不保證各子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，不負責各子基金之盈虧，亦不保證最低之收益，投資人申購前應詳閱本傘型基金公開說明書。元大15年期以上新興市場主權債ETF基金有一定比重投資於非投資等級之高風險債券，由於非投資等級債券之信用評等未達投資等級或未經信用評等，且對利率變動的敏感度甚高，故本子基金可能因利率上升、市場流動性下降或債券發行機構違約不支付利息、本金或破產而蒙受虧損。因此，本子基金不適合無法承受相關風險之投資人，且投資人不宜占其投資組合過高之比重。本子基金適合能承受較高風險之非保守型投資人。投資人交易本傘型基金之二檔子基金前，應再特別注意下列事項：1、各子基金之操作目標在追蹤與標的指數相關之報酬(元大中國政策性金融債5年期以上債券ETF基金之標的指數為彭博中國政策性金融債5年期以上債券指數；元大15年期以上新興市場主權債ETF基金之標的指數為ICE 新興市場15年期以上美元主權債券指數)，而標的成分債券之價格波動(包括但不限於受利多、利空、或除息、債券交易市場流動性不足、交易對手之信用風險、利率風險等因素影響)將影響各子基金標的指數的走勢，然各子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。2、各子基金雖以追蹤標的指數為操作目標，然下列因素仍可能使各子基金報酬偏離標的指數報酬，且偏離方向無法預估：(1)各子基金可能因應申購、買回或維持所需曝險比例等因素而需每日進行基金曝險調整，故基金淨值將受到每日所交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費、上櫃費等)、投資組合成分價格波動或基金整體曝險比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。(2)各子基金投資組合與標的指數相關性將受到基金持有之有價證券或期貨與標的指數之相關性等因素影響。此外，基金投資組合中持有的期貨部位，因期貨的價格發現功能使其對市場信息、多空走勢之價格反應可能不同於債券，因此當市場出現特定信息時，基金淨值將同時承受期貨及債券對市場信息反應不一所產生的價格波動影響，可能使各子基金報酬將與投資目標產生偏離。有關各子基金投資策略請詳見本傘型基金公開說明書【基金概況】/壹、基金簡介/十、投資策略及特色之重點摘述之說明。(3)各子基金均以新臺幣計價，而各子基金所投資的有價證券或期貨標的可能為新臺幣以外之計價貨幣，因此各子基金承受相關匯率波動風險可能使各子基金報酬與投資目標產生偏離。各子基金自成立日起，即運用各子基金資產進行投資組合佈局，各子基金投資組合成分價格波動會影響各子基金淨值表現。投資人於各子基金成立日(不含當日)前參與申購所買入的各子基金每受益權單位之發行價格，不等同於各子基金掛牌上櫃之價格，參與申購投資人需自行承擔各子基金自成立日起至掛牌日止期間之各子基金淨資產價格波動所產生折/溢價的風險。各子基金上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受各子基金受益權單位數之買回。各子基金受益憑證上櫃後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱證券櫃檯買賣中心)所有關規定辦理。本傘型基金之各子基金於上櫃日後將依證券櫃檯買賣中心所規定於臺灣證券交易時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。各子基金淨值以新臺幣計價而基金主要投資標的為外幣計價債券或期貨，因此匯率波動會影響各子基金淨值之計算，而計算盤中估計淨值所使用的盤中即時匯率，因評價時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算之匯率或有差異，因此計算盤中估計淨值與實際基金淨值計算之基金投資組合或有差異，投資人應注意盤中估計淨值與實際基金淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際基金淨值應以經理公司最終公告之每日淨值為準。各子基金自上櫃日(含當日)起之申購，經理公司將依本傘型基金公開說明書規定依各子基金「現金申購/買回日清單公告」所載之「每申購/買回基數約當市值」加計105%~106%(依各子基金規定辦理)，向申購人預收申購價金。惟如遇臺灣證券市場連續休假日之情事者，前述一定比例之比重得由經理公司公告後機動調整，並應於調整後三個營業日內恢復各子基金規定之比例。投資涉及新興市場部份，其波動性與風險程度可能較高，且其政治與經濟情勢穩定度可能低於已開發國家，也可能使資產價值受不同程度之影響。由於中國大陸仍屬高度監理的投資區域，故雖然目前持續開放境外機構投資者參與，利用中、港債券市場交易互聯互通機制(即債券通交易)的管道交易中國債券仍有交易機制不確定性之投資風險，未來中國大陸相關法令的變動是否影響境外機構投資人的投資利益，仍需持續留意。投資人交易前，應詳閱本傘型基金公開說明書並確定已充分瞭解各子基金之風險及特性。