

統一股債傘型基金之統一美國公債量化增益主動式ETF基金(基金之配息來源可能為收益平準金)

簡式公開說明書

刊印日期：115年7月20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	統一股債傘型基金之統一美國公債量化增益主動式 ETF 基金(基金之配息來源可能為收益平準金)	成立日期	年 月 日
經理公司	統一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	第一商業銀行	基金種類	主動式交易所交易基金
受託管理機構	無	投資地區	投資國內外
國外投資顧問公司	無	存續期間	不定期限
收益分配	季配息	計價幣別	新臺幣
績效指標 Benchmark	ICE 美國政府 20+年期債券指數 (ICE U.S. Treasury 20+ Year Bond Index)，績效指標之特性、基金與績效指標對投資策略及特色之差異比較、基金表現與績效指標表現之差異比較及其比較方式之定義及計算公式等事項請詳公開說明書第 28~29 頁。	保證機構	無,本基金非保證型
		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：

本基金自成立日起屆滿三個月後(含)，整體資產組合之加權平均存續期間應在一年以上(含)。本基金自上櫃日起，投資於外國有價證券之總金額不得低於本基金淨資產價值之百分之七十(含)。投資於美國公債相關之有價證券總金額不得低於本基金淨資產價值之百分之六十(含)。本基金所投資債券之信用評等應符合金管會所規定之信用評等機構評定達一定等級以上者。

二、投資特色：

- 1.獲取Alpha報酬：主動創造收益，獲取息收以外的收益。
- 2.獨家美債量化模型：結合總經基本面與動能技術面，判斷美債轉折點，捕捉波段行情。
- 3.動態風險控管機制：靈活運用避險工具，嚴守停損紀律，降低淨值波動。

參、投資本基金之主要風險

- 一、國內外政經情勢、未來發展或現有法規之變動，均可能對本基金所參與的投資市場及投資工具之報酬造成直接或間接的影響。
- 二、本基金所涉之各證券市場交易時間不同，因此基金所涉之證券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。**本基金可投資於美國 144A 債券，該債券屬私募性質，較可能發生流動性不足，財務訊息揭露不完整或因價格不透明導致波動性較大之風險。**
- 三、請詳細閱讀本基金公開說明書第 27~33 頁，投資本基金應注意之相關風險。
- 四、本基金主要投資標的為美國公債，使用統一投信研發設計的量化交易模組，依多空訊號主動進行增益或避險操作，而非僅是持有債券、被動領息。量化交易模組由與股債匯市相關性的基本面因子，以及資金籌碼面的動能因子組成，藉此得出債市多空轉折訊號，再靈活運用期貨、槓桿/反向

ETF 進行增益或避險操作，以賺取息收以外的 Alpha 報酬並降低淨值波動。本基金適合可適度承擔利率及匯率風險，追求穩定收益及長期穩健績效之投資人。參酌中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會公布基金投資標的風險屬性和投資地區市場風險狀況分析，**基金風險報酬等級為 RR2**，RR 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，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)，不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所投資基金個別的風險。相關資料(如年化標準差、Alpha、Beta 及 Sharpe 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。

肆、本基金適合之投資人屬性分析

本基金為債券型之主動式交易所交易基金，主要布局於美國公債，適合可適度承擔利率及匯率風險，追求穩定收益及長期穩健績效之投資人。

伍、基金運用狀況

(本基金尚未成立)

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		基金淨資產價值 200 億元(含)以下：0.80% 基金淨資產價值逾 200 億元之部分：0.70%
保管費		基金淨資產價值 200 億元(含)以下：0.10% 基金淨資產價值逾 200 億元之部分：0.08%
上櫃費及年費		每年上櫃費用為資產規模之 0.021%~0.03%，最高金額為新臺幣 30 萬元。
短線交易買回費用		不適用
績效指標授權費		每年基金平均淨資產之 0.01% (每季支付)
召開受益人會議費用		預估每次新台幣 100 萬元。 (受益人會議並非每年固定召開，故其費用不一定每年發生)
其他費用(註一)		以實際發生數額為準
申購手續費 (成立日前)		每受益權單位淨資產價值 2%，實際費率由經理公司依銷售方式不同作適當調整。
掛牌日起 透過 初級 市場 申購 買回 作業 之	申購手續費 (掛牌日起)	申購手續費=本基金每受益權單位之申購手續費最高不得超過本基金每受益權單位淨資產價值 2%，申購手續費不列入本基金資產。實際費率由經理公司依銷售方式不同作適當調整。
	申購交易費	申購交易費=實際申購價金×申購交易費率。 申購交易費率收取標準為申購日基金實際成交價減去基金債券評價後除以基金債券評價之加權平均價差及匯率波動成本。該費率得依基金投資策略、投資標的及市場現況進行調整。
	買回手續費	經理公司得就每一買回申請收取買回手續費，每受益權單位之買回手續費，最高不得超過本基金每受益權單位淨資產價值 2%。買回手續費不列入本基金資產，實際費率由經理公司依銷售方式不同作適當調整。
	買回交易費	買回交易費=實際買回價金×買回交易費率。 買回交易費率收取標準為買回日基金債券評價減去基金實際成交價後除以基金債券評價之加權平均價差及匯率波動成本。該費率得依基金投資策略、投資標的及市場現況進行調整。
	買回費用	無
	買回收件手續費	無
行政處理費		申購人若發生申購失敗或買回失敗時，應支付行政處理費。

費用	受益人應負擔費用之給付方式 1. 申購手續費及申購交易費於申購時另行支付。 2. 買回手續費及買回交易費於買回時另行支付。 3. 行政處理費於申購失敗時或買回失敗時另行支付。 除前述 1~3 外，其餘項目均由基金資產中支付。
	(註一)包括依信託契約規定運用本基金所生之經紀商佣金、交易手續費、短期票券之集保費、出借有價證券等直接成本與必要費用；本基金應支付之一切稅捐、基金財務報告簽證或核閱費用；清算費用及訴訟或非訴訟所產生之費用；受益人若發生申購/買回失敗應支付行政處理費。
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。詳細內容請參見公開說明書第 48~49 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之淨資產價值。 二、公告方式：於經理公司各營業處所、公司網站（http://www.ezmoney.com.tw）或中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會網站。	
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、投資人亦可於經理公司網站（http://www.ezmoney.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	
統一投信客服專線：0800-018-889	

一、本基金經金融監督管理委員會或其指定機構申請核准，惟不表示本基金絕無風險。基金經理公司以往之經理績效不保證本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。本基金掛牌上櫃前參與申購所買入的基金每受益權單位發行價格，不等同於基金掛牌上櫃價格，參與申購之投資人需自行承擔基金成立日起至上櫃日止間，基金每受益權單位發行價格與上櫃價格所產生折/溢價之風險。
二、本基金投資目標未追蹤、模擬或複製特定指數之表現，而係經理公司依其所訂投資策略進行基金投資。
三、本基金之基金配息不代表基金實際報酬，且過去配息不代表未來配息；基金淨值可能因市因素而上下波動。本基金配息可能由基金的收益或收益平準金中支付。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。收益平準金係指本基金成立日，計算日之每日受益權單位淨資產價值中，相當於原受益人可分配之收入支出淨額。本基金最近12個月內配息組成相關資料(將)已揭露於統一投信網站。
四、本基金自成立日起至上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受本基金受益權單位之申購或買回。
五、本基金無受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障，投資本基金可能發生部分或本金之損失，最大損失為全部投資之金額，投資人須自負盈虧。
六、本基金公開說明書可至經理公司之網址「統一投信輕鬆理財網」(www.ezmoney.com.tw)或至「公開資訊觀測站」(http://mops.twse.com.tw)下載。