



康和多空成長期貨信託基金

Concord Dream Futures Trust Fund

核心配置 | 截至：2014/9/30

基金簡介

康和多空成長期貨信託基金是註冊於中華民國的開放式基金。基金的投資是以分散風險、確保基金之安全，以積極追求長期投資利得及維持收益安定為目標，以誠信原則及專業經營方式，將本基金運用於全球期貨交易及國內有價證券。康和多空成長期貨信託基金以 1.期貨避險套利、2.股票價值投資、3.現金固定收益 三大優勢策略，組成之資產配置結構，運用期貨多空雙向特性，替股票進行避險，以及多元配置於全球4大洲、12交易所、57種以上期貨商品近千套交易策略分散風險，並將流動性準備配置於RP、人民幣定存等固定收益低曝險，避險、分散風險、低曝險，讓資產不受股市空頭、景氣循環影響，長期穩健增值。

基金概要

彭博代碼	CONDFTF TT Equity
基金類型	一般型
投資標的	全球期貨 國內股票
成立日期	2013/12/6
計價幣別	新台幣
起始淨值	10.000
最低申購金額	單筆 NTD 10,000元起 定期定額 NTD 3,000元起
申購手續費	最高2%
買回付款日	T+5 (T為營業日)
經理費	2.50%
保管費	0.20%
經理人	林豪威
保管銀行	永豐銀行
風險等級	R1

成長方程式

策略名稱	策略簡介	主要投資標的	資金配置 (常態)
I. 期貨避險套利	期貨套利模組、全球商品型態辨識系統近千套交易策略	全球4大洲、12交易所、57種以上期貨商品	存放25%期貨保證金，近五日平均持倉期貨總市值以不超過基金規模3.5倍為限，實際投資比重如下表
II. 股票價值投資	股票價值投資、期貨避險模組、債券收益	國內上市櫃股票、期貨及選擇權	35%
III. 現金固定收益	RP、定存等流動性準備	新台幣RP、人民幣定存	40%

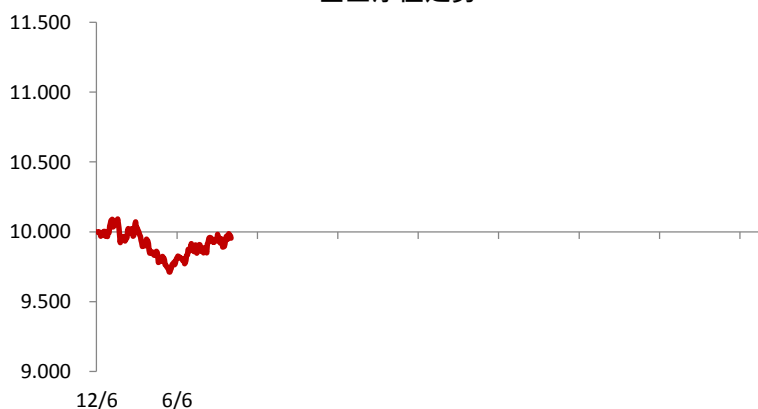
月績效表現 (單位：%)

	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年度
2013年												-0.07	-0.07
2014年	-0.33	0.63	-0.76	-1.40	-0.44	1.13	-0.13	0.75	0.19				-0.38
2015年													

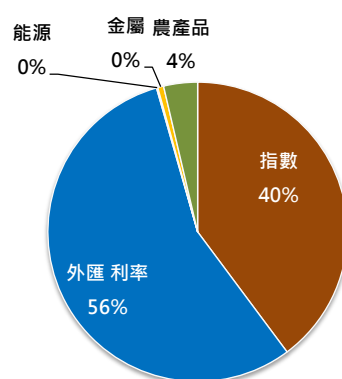
投資資訊

規模及淨值	基金績效分析	成立以來	今年以來	本月	年化報酬率	年化波動度
基金規模	康和多空成長期貨信託基金	-0.45%	-0.38%	0.19%	-0.6%	3.4%
最新淨值						
9.955 元						
前五大商品投資市值	投資比重與績效貢獻	投資比重	本月			
5年期美國公債	-17.54%	I. 期貨避險套利	61%	0.41%		
台灣台指選擇權	-8.04%	II. 股票價值投資	36%	-0.59%		
台積電	6.65%	III. 現金固定收益	43%	0.59%		
芝加哥日元Opti	-5.12%					
10年期歐元公債	4.27%					
註：正為多倉，負為空倉						

基金淨值走勢



期貨避險套利 商品類別投資比重



期貨避險套利 全商品投資比重 (正為多倉 負為空倉)

策略名稱	投資比重 (%)
小道瓊斯指數	3.5
30年期美國公債	2.5
台灣加權指數	1.5
SGX 摩台指數	1.0
SGX 新加坡指數	1.0
SGX 日經225 指數	0.5
小那斯達克指數	0.5
香港恒生指數	0.5
香港金銀指數	0.5
台灣金融指數	0.5
5年期美國公債	0.5
10年期美國公債	0.5
英國FTSE100 指數	0.5
歐洲50 指數	0.5
德國CAC40 指數	0.5
法國CAC40 指數	0.5
台灣電子指數	0.5
S&P500 指數	0.5
ICE 美元指數	0.5
美國棉花	0.5
美國瘦豬	0.5
美國活牛Option	0.5
美國11號糖Option	0.5
美國棉花Option	0.5
美國咖啡Option	0.5
美國小麥Option	0.5
美國玉米Option	0.5
美國黃豆粉Option	0.5
美國黃豆Option	0.5
美國白銀Option	0.5
美國黃金Option	0.5
美國天然氣Option	0.5
美國輕原油Option	0.5
台灣台指選擇權	0.5
香港恒生指數Option	0.5
香港恒生指數Option	0.5
SGX 日經225 指數...	0.5
法國CAC40 指數Option	0.5
英國FTSE100 指數...	0.5
德國DAX 指數Option	0.5
歐洲50 指數Option	0.5
S&P500 指數Option	0.5
30年期美國公債Option	0.5
芝加哥澳幣Option	0.5
芝加哥日圓Option	0.5
芝加哥英鎊Option	0.5
芝加哥歐元Option	0.5
芝加哥加幣Option	0.5
芝加哥加幣Option	0.5