



康和多空成長期貨信託基金

Concord Dream Futures Trust Fund

核心配置 | 截至：2014/4/30

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	CONDTF 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	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%

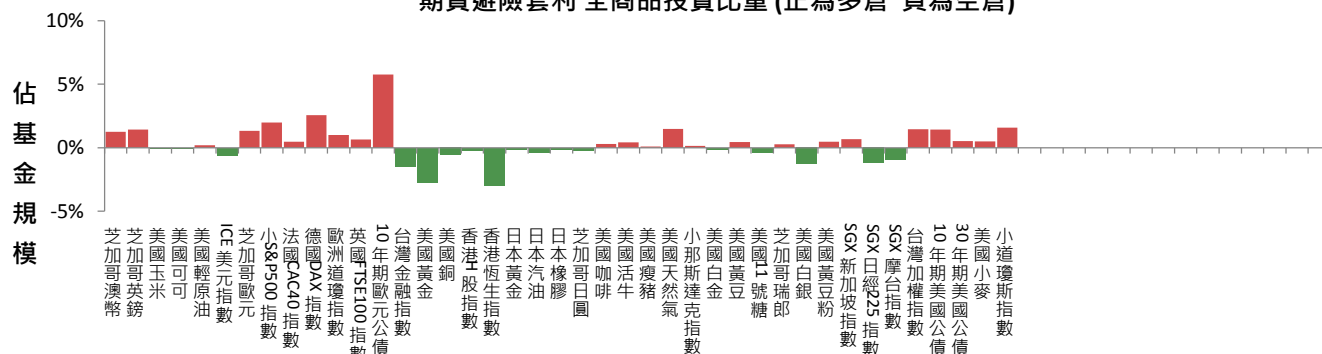
月績效表現 (註：本基金成立未滿六個月，依法令規定未能揭露績效)

	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													
2014年													
2015年													

投資資訊

規模及淨值	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 15.7 億元	康和多空成長期貨信託基金					
最新淨值 9.808 元	(註：本基金成立未滿六個月，依法令規定未能揭露績效)					
投資比重 (以市值計算)	相關係數	加權指數				
期貨避險套利 57.6%	康和多空成長期貨信託基金	-0.60				
股票價值投資 33.9%						
現金固定收益 31.5%						
前五大商品投資市值 (正為多倉 負為空倉)						
台積電	6.41%					
10年期歐元公債	5.76%					
富邦金	3.42%					
香港恆生指數	-2.98%					
美國黃金	-2.74%					

期貨避險套利 全商品投資比重 (正為多倉 負為空倉)



經理人評論

基金以追求絕對報酬為目標，有別於一般傳統投資，投資範圍跨商品、涵蓋策略之多，交易流程之繁複，皆為國內首創，更為國內第一檔採避險基金架構，全天候24hrs交易全世界且多空雙向的基金。目前三大策略投資比重，期貨避險套利為58% (總市值)，近五日平均持倉期貨總市值為基金規模之0.67倍；股票價值投資為34%，持有國內上市櫃股票合計45檔；現金固定收益為31%，其中人民幣定存部位為31%。

以上資料來源：彭博、期貨公會、康和期經 資料截止日期：2014/4/30

相關投資內容為至資料截止日期所呈現之資訊，未來投資狀況將視當時市場走勢隨時進行調整。

| 康和期貨經理事業獨立經營管理 | 本期貨信託基金經目的事業主管機關核准，惟不表示本基金絕無風險，本期貨信託事業以往之績效不保證基金之最低投資收益；本期貨信託事業除盡善良管理人之注意義務之外，不負責本基金之盈虧，亦不保證最低之收益，投資一定有風險，基金投資有賺有賠，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。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。投資人可向本公司及基金之銷售機構索取本基金之公開說明書，或至本公司網站 (fm.concordfutures.com.tw) 或期信基金資訊觀測站 (www.fundclear.com.tw) 自行下載。有關基金應負擔之費用已揭露於基金之公開說明書或投資人須知中，投資人可至期信基金資訊觀測站中查詢。為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理之交易成本增加，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。若受益人持有本基金未滿七個日曆日 (含) 且申請買回受益憑證時本基金業已成立者，應支付買回價金之萬分之一 (0.01%) 之買回費用，

服務專線：(02)3765-3688 / 0800-003958

公司地址：台北市信義區基隆路一段176號14樓

許可證字號：102年金管期經字第001號