



康和多空成長期貨信託基金

Concord Dream Futures Trust Fund

核心配置 | 截至：2014/12/31

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	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%

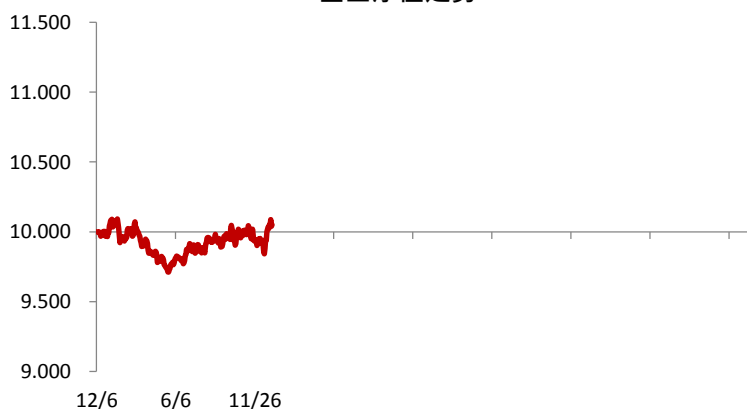
月績效表現 (單位：%)

	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	0.20	-0.39	1.17	0.59
2015年													

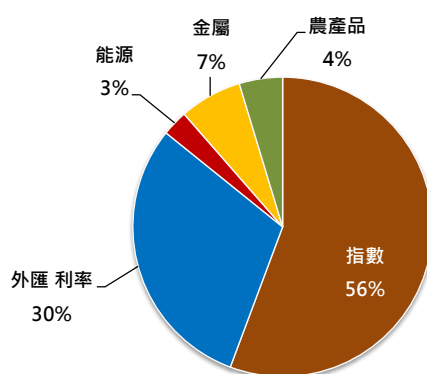
投資資訊

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	0.52%	0.59%	1.17%	0.50%	3.84%
最新淨值						
前五大商品投資市值	投資比重與績效貢獻	投資比重	本月			
台灣加權指數	I. 期貨避險套利	60%	0.95%			
台灣台指選擇權	II. 股票價值投資	49%	0.02%			
芝加哥歐元Opti	III. 現金固定收益	43%	0.49%			
台積電						
德國DAX指數						
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 (%)
芝加哥金鎊Option	-7.5%
芝加哥英鎊Option	-3.5%
芝加哥日圓Option	-1.5%
芝加哥澳幣Option	0.5%
30年期美公債..	0.8%
歐洲DAX指數Option	0.2%
S&P500指數Option	0.1%
德國DAX指數Option	0.1%
英國FTSE100指數..	0.1%
法國CAC40指數Option	0.1%
SGX日經225指數..	0.1%
香港恆生指數Option	0.1%
台灣台指選擇權	0.1%
美國天然氣Option	0.1%
美國輕原油Option	0.1%
美國黃金Option	0.1%
美國白銀Option	0.1%
美國黃豆Option	0.1%
美國玉米Option	0.1%
美國小麥Option	0.1%
美國咖啡Option	0.1%
美國棉花Option	0.1%
美國11號糖Option	0.1%
美國活牛Option	0.1%
美國豬豬Option	0.1%
芝加哥漢幣	0.1%
美國輕原油	0.1%
ICE美元指數	0.1%
芝加哥歐元	0.1%
S&P500指數	0.1%
台灣電子指數	0.1%
法國CAC40指數	0.1%
德國DAX指數	0.1%
歐道50指數	0.1%
英國FTSE100指數	0.1%
台灣金融指數	0.1%
美國黃金	0.1%
香港熱燃油	0.1%
美國天然氣	0.1%
香港恒生指數	0.1%
日本黃金	0.1%
日本汽油	0.1%
日本橡膠	0.1%
芝加哥日圓	0.1%
美國天然氣	0.1%
小那斯達克指數	0.1%
美國大豆	0.1%
SGX富時中國50指數	0.1%
美國白銀	6.5%
SGX新加坡指數	2.5%
SGX日經225指數	1.5%
芝加哥金鎊Option	0.1%