

兆豐首創  動態平衡

# 00982T

## 兆豐台美動態股債平衡ETF (基金之配息來源可能為收益平準金)

股票代號

### F.B.I 投組三大特色

聚焦  
台股美債

**F**ocus

一檔擁有  
股債組合

**B**oth stocks  
and bonds

股債組合  
動態調整

**I**nvest  
dynamically



### 台股+美債投組策略

台股精選上市櫃具成長性企業，加上美國長天期公債可累積固定收益作為防守策略，達到進可攻退可守之投資組合。

台股: 前瞻科技股

具價值投資、動能及代表性企業

電子、數位雲端及綠能



美債: 固定收益資產

具避險收益價值

分散佈局  
20年期以上美國公債



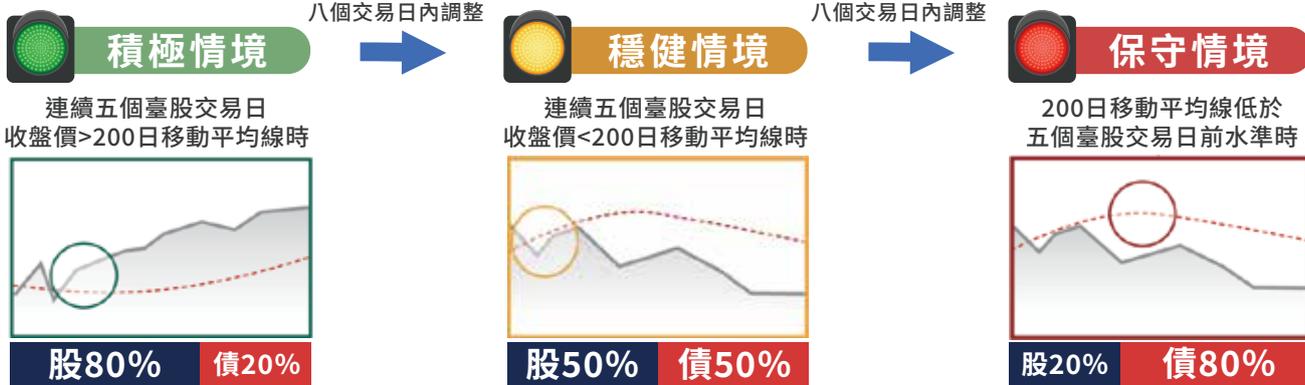
資料來源: 臺灣指數公司。以上個股僅為舉例說明，非為基金必然之投資，不代表未來實際績效，亦無獲利保證之意圖。投資策略為現階段因應市場狀況所擬定，未來仍可能隨市場之變化彈性調整投資策略。投資人申購本基金係持有基金受益憑證，而非本文提及之投資資產或標的。有關本基金運用限制及投資風險之揭露，請詳閱基金公開說明書。本文提及之歷史績效數據不必然代表本基金之績效，本指數組合已經篩選達分散性，惟仍具有相當程度的風險，投資人仍應注意所有投資本基金之風險，本基金適合追求長期資本增值且能承受標的指數價格波動之風險非保守型投資人。兆豐投信整理；資料期間: 2025/9。

### 全台首發技術分析平衡ETF

※ 特殊情境

連續五個台股交易日收盤價於200日移動平均線偏離達30%以上時，股票比例為50%，債券比例為50%。

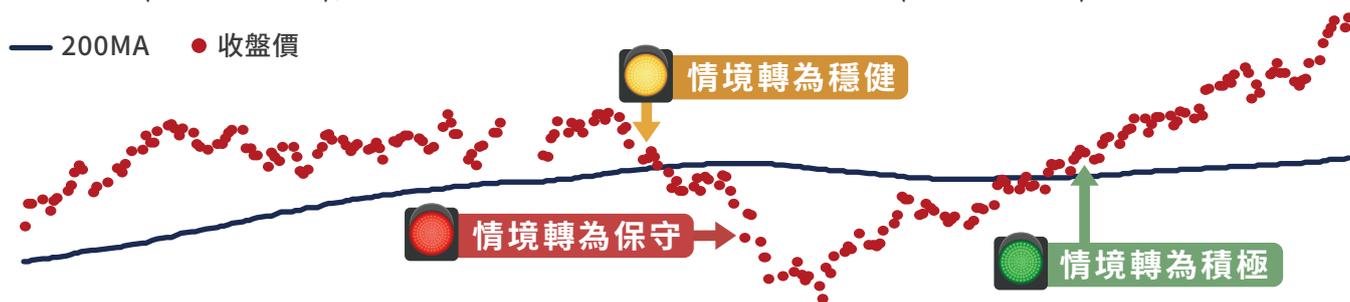
指數成分調整情境



資料來源: 臺灣指數公司。股債指數為特選臺灣動能趨勢指數及彭博20年期以上美國公債指數(新臺幣計價)。投資策略為現階段因應市場狀況所擬定，未來仍可能隨市場之變化彈性調整投資策略。投資人申購本基金持有基金受益憑證，而非本文提及之投資資產或標的。本文提及之歷史績效數據不必然代表本基金之績效，有關本基金運用限制及投資風險之揭露，請詳閱基金公開說明書。本指數組合已經篩選達分散性，惟仍具有相當程度的風險，投資人仍應注意所有投資本基金之風險，本基金適合追求長期資本增值且能承受標的指數價格波動之風險非保守型投資人。兆豐投信整理；資料期間: 2025/9。

### 指數調整情境分析

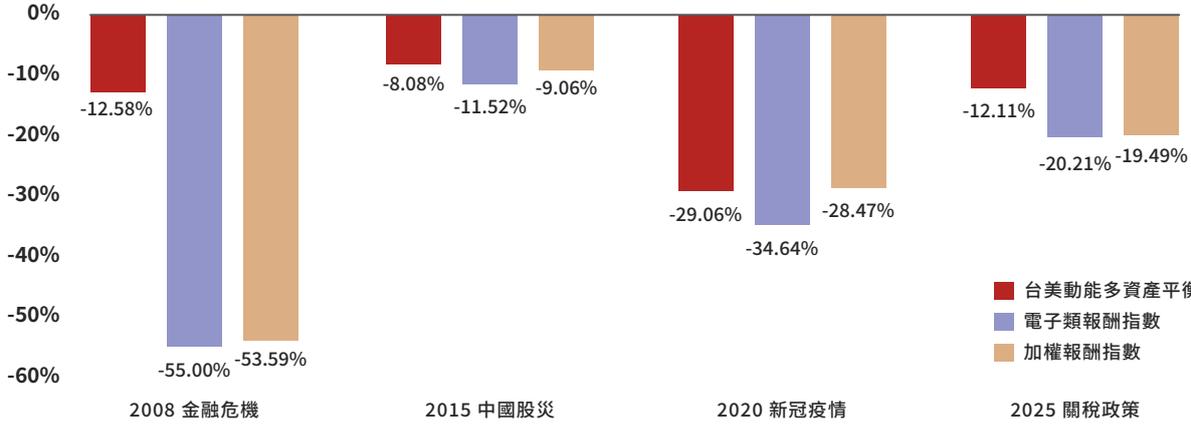
根據指數調整情境分析，當指數低於200日移動平均線時，操作策略將轉為穩健(股50%、債50%)；200日移動平均線低於五個交易日前水準時，操作策略將轉為保守(股20%、債80%)；指數高於200日移動平均線時操作策略將轉為積極(股80%、債20%)。



資料來源: 上圖為指數調整情境之示意圖。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，有關本基金運用限制及投資風險之揭露，請詳閱基金公開說明書。本指數組合已經篩選達分散性，惟仍具有相當程度的風險，投資人仍應注意所有投資本基金之風險，本基金適合追求長期資本增值且能承受標的指數價格波動之風險非保守型投資人。兆豐投信整理；資料期間: 2025/9。

# 當熊來了 動態股債平衡相對具抗震力

回顧各類金融風險事件，台股+美債組合下相對具有降低波動風險的防禦力，相對適合做為投資組合中固定收益資產配置。



資料來源：臺灣指數公司。最大跌幅資料期間：金融危機(2008/3/13-2009/6/30)、中國股災(2015/6/1-2015/7/31)、新冠疫情(2020/2/3-2023/3/31)及關稅政策(2025/3/28-2025/4/30)。以上僅為歷史資料模擬回測結果，不代表未來之績效保證。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，有關基金運用限制及投資風險之揭露，請詳閱基金公開說明書。兆豐投信整理；資料期間：2025/9。

## 股債指數編製規則

### 指數成分股\*

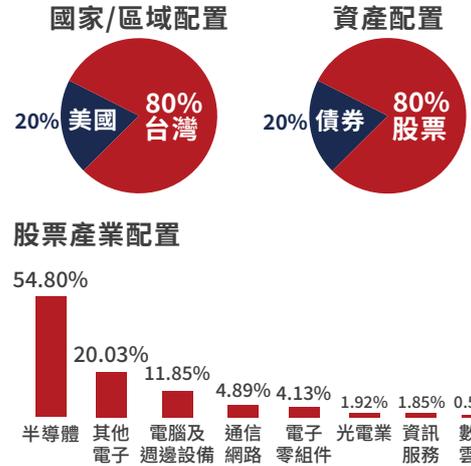
- 流動性篩選**：滿足以下任一條件視為通過流動性檢驗。
  - 近12個月成交金額總額前20%高者。
  - 近12個月至少有8個月自由流通週轉率達3%。
- 指標篩選**：流動性檢驗近三年每年皆獲利篩選：
  - 市值指標：發行市值達新臺幣100億元者。
  - 價值指標：本益比屬前70%低者。
- 排序方式**：綜合分數擇優選取前30檔股票為成分股。
  - 動態指標：以12:4:2:1(近1個月、1季、半年及1年之年化報酬計算標準化分數)比例加總計算。
  - 市值指標：以發行市值計算標準化分數。
- 權重計算**：自由流通市值加權

### 指數成分債\*

- 品質篩選**：美元計價的固定票息債券
- 年期篩選**：剩餘到期期限大於20年
- 流動性篩選**：個別債券發行總額，扣除美國聯邦儲備持有部位後須超過3億美元。
- 權重計算**：市值加權計算權重

## 追蹤指數基本資料

臺灣指數公司彭博台股動能多資產平衡指數



資料來源：臺灣指數公司、彭博資訊。\*指數成分股係以臺灣證券交易所上市與中華民國證券櫃檯買賣中心上櫃普通股股票為母體；指數成份債以美國公債為母體。投資策略為現階段因應市場狀況所擬定，未來仍可能隨市場之變化彈性調整投資策略。投資人申購本基金係持有基金受益憑證，而非本文提及之投資資產或標的，有關本基金運用限制及投資風險之揭露，請詳閱基金公開說明書。兆豐投信整理；資料期間：2025/9。

<b>基金簡稱</b>	平衡兆豐台股動能	<b>保管銀行</b>	元大銀行
<b>證券代碼</b>	00982T	<b>經理年費</b>	0.80%
<b>發行幣別/價格</b> 成立日前(不含當日)	新臺幣10元	<b>保管年費</b>	50億元(含)以下:0.18% 超過50億元~100億元(含)以下:0.16% 超過100億元:0.14%
<b>風險報酬等級</b>	RR4*		
<b>收益分配</b>	半年付息，基金成立日起滿90日(含)後，經理公司得決定分配收益。		

資料來源：兆豐投信整理；資料期間：2025/9。\*風險報酬等級為本公司依投信投顧公會「基金風險報酬等級分類標準」編製，該分類標準係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級，分類為RR1-RR5五級，數字越大代表風險越高。此等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：投資標的產業風險及流動性風險等)，不宜作為投資唯一依據。

投資一定有風險，基金投資有賺有賠，申購前應詳閱基金公開說明書。

【兆豐投信獨立經營管理】本公司系列基金雖經金融監督管理委員會或其指定機構核准或同意生效，惟不表示絕無風險。基金經理公司以往之經理績效不保證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。本基金自成立日起至上市日前(不含當日)，經理公司不接受本基金受益權單位之申購或贖回。本基金受益憑證之上市買賣，應依證券交易所場有關規定辦理。本基金自成立日起，運用基金資產進行投資組合佈局，基金投資組合成分價格波動會影響基金淨值表現。投資人於成立日(不含當日)前參與申購所買入之本基金每受益權單位之發行價格(即新臺幣10元)，不等同於基金掛牌上市之價格，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生折/溢價之風險。基金受益憑證上市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股份有限公司(以下簡稱臺灣證交所)所有規定辦理。本基金以追蹤標的指數報酬為操作目標，而標的指數之成分證券價格波動將影響標的指數的走勢，當標的指數的成分證券價格波動劇烈或變化時，本基金之淨資產價值亦承受大幅波動的風險。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基金報酬與標的指數報酬，且偏離方向無法預估：1. 本基金可能因應申購或維持所需備險比例等因素而需每日進行基金曝險調整，故基金淨值將受到所交易之有價證券或期貨價格波動、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費、上市費、指數授權費等)或基金整體曝險比例等因素影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。2. 本基金投資國家之政治、經濟或法令等相關投資規定若改變時，亦存在一定程度之投資風險，雖投資指數股票型基金具有分散各標的風險效果，惟仍具有相當程度的風險。投資人仍應注意所有投資本基金之風險。本基金可能面臨之投資風險包含：產業景氣循環風險、流動性風險、外匯管制及匯率變動風險、投資地區政治、經濟變動風險等。參閱中華民國投信投顧公會之基金風險報酬等級分類標準，故風險報酬等級為RR4。此等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，不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所投資基金個別之風險。本基金為指數股票型基金，結合股票與債券的特質，區分市場情境，設定股債比例，運用「臺灣指數公司特選臺灣上市上櫃動能趨勢指數」與「彭博20年期以上美國公債指數(新臺幣計價)」，塑造兼具分散風險與追求穩健收益的多資產投資策略，達到較佳的風險調整後收益表現。雖指數組合已經歷過分散性，仍具有相當程度的風險，投資人仍應注意所有投資本基金之風險。本基金適合追求長期資本增值且能承受較高的指數價格波動之風險。本基金收益分配採半年付息機制，基金配息不代表基金資產增加，且過去配息不代表未來配息，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或收益平準金中支付。任何涉及由收益平準金支付的部份，可能導致原始投資金額減少。本基金淨值組成項目，可於經理公司網站查詢。基金於上市日後將依臺灣證交所規定於臺灣證券交易所場內提供盤中估計淨值供投資人參考。基金淨值以新臺幣計價而基金主要投資標的為外幣計價有價證券或期貨，因此匯率波動會影響本基金淨值之計算，而計算盤中估計淨值時點及資訊來源不同，與實際基金淨值計算或有差異。投資人注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差之風險，經理公司向臺灣證券交易所場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。最大可能損失：基金交易係以長期投資為目的，不宜期待於短期內獲取高收益。投資風險可能影響基金淨值之表現，任何基金單位之價格及其收益於任一時間點均可漲或跌，故基金投資人不一定能取回全部或任一部份之投資金額。指數編製公司免責聲明：「臺灣指數公司」及「兆豐投信」共同開發，並由臺灣指數公司單獨授權兆豐國際證券投資信託股份有限公司使用。「合作單位」並未以任何方式贊助、背書、出售或促銷「兆豐台股動能股債平衡ETF」證券投資信託基金(基金之配息來源可能為收益平準金)，且「合作單位」亦未明示或默示對使用指數之結果及/或指數於任一特定日期之任一特定時間或其時間之數據提供任何保證或聲明。指數係由臺灣指數公司所計算，然「合作單位」就指數之任何錯誤、不正確、遺漏或指數資料之傳輸中斷對任何人均不負責任，且無任何義務將該等錯誤、不正確或遺漏通知任何人。本基金不受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障，投資人需自負盈虧。故投資本基金可能發生部分或全部本金之損失，最大可能損失則為全部投資金額。金融消費爭議處理及申訴管道：就本公司所提供之金融商品或服務所生紛爭投資人應先向本公司提出申訴，若三十日內未獲回覆或投資人對處理結果不滿意處理結果得於六十日內向「金融消費評議中心」申請評議。本資料係整理分析各方面資訊之結果，純屬參考性質，本公司不持有任何保證或承諾，請勿將本內容視為對個別投資人做基金買賣或其他任何投資之建議或要約。本公司已力求其中資訊之正確與完整，惟不保證本內容絕對正確無誤。未經授權不得複製、修改、再製或散發引用。查詢基金公開說明書之網址：1. 公開資訊觀測站：https://mops.twse.com.tw 2. 兆豐投信：https://www.megafunds.com.tw 兆豐國際證券投資信託股份有限公司 | 110年金管投信字第009號 | 公司電話：02-2175-8388 | 客服專線：02-2175-8368 | 地址：台北市松山區復興北路167號17樓。