

群益證券投資信託股份有限公司
基金從事證券相關商品交易彙總表(保本型基金以外之其他類型基金適用)
2024年5月

基金 類型 代號	基金代號	基金名稱	基金成立日期	基金淨資產價值	期貨(或選擇權) - Swap、OTC證券相關商品		期貨(或選擇權) - Swap、OTC證券相關商品 種類 (註2)	期貨(或選擇權) - Swap、OTC證券相關商品 契約價值或 名目本金	期貨(或選擇權) - Swap、OTC證券相關商品 未實現損益	期貨(或選擇權) - Swap、OTC證券相關商品 保證金金額	為避險需要						持有以我國證券、證券組合 或股價指數為 標的之國內外 期貨或選擇權 所持證券總市 值之總額	投資於任 一公司證券 或證券組合 之價值	投資於任 一公司證券 或證券組合 之價值	投資於任 一公司證券 或證券組合 之價值	投資於任 一公司證券 或證券組合 之價值	投資於任 一公司證券 或證券組合 之價值						
					期貨 或選擇 權	Swap 、OTC 證券相 關商品 契約內容 (註3)					買進選 擇權買 權之總 (名目) 價值 (註4)	Swa p、 OTC 證券相 關商品 之總 (名 目) 價值 (註4)	基金所持 有價證券總 市值 (A) 占基金 淨資產 價值之 比例 (B)	(A)+(B) +(C)+(D) 占基金 淨資產 價值之 比例 (E)	未沖銷多頭部位 之期貨契約總市 值(A) 占基金 淨資產 價值之 比例 (F)	買進選 擇權買 權之總 (名目) 價值 (G)	買進選 擇權買 權之總 (名目) 價值 (H)	(A)+(B)+(C) 占基金 淨資產 價值之 比例 (I)	Swap 、OTC 證券相 關商品 之總 (名 目) 價值 (J)	(E)+(F)+(G) +(H)+(I) +(J)	可相 互沖 抵之 未沖 銷多 頭部 位之 契約 總市 值(J)	(K)	(L)	(M)	(N)	(O)	(P)	
AH1_3	DDE01	臺灣加權正2基金	2017/3/23	579,824,388	TX	6	273	1,151,806,800	10,518,000	59,514,000	0	0	0	0	0	0.00	0.00	1,162,324,800	0	0	0	0	0	200.46	0.00	0.00	0.00	
AH1_3	DDE02	臺灣加權反1基金	2017/3/23	122,293,919	MTX	6	10	10,439,750	-204,250	6,213,000	121,341,600	0	0	0	0	0	0.00	99.22	0	0	0	0	0	0.00	0.00	0.00	策略 交易	
AH1_3	DDE02	臺灣加權反1基金	2017/3/23	122,293,919	TX	6	26	108,686,200	-2,011,400	6,213,000	121,341,600	0	0	0	0	0	0.00	99.22	0	0	0	0	0	0.00	0.00	0.00	策略 交易	
AH1_1	DDE03	群益台灣選高息ETF基金	2022/10/13	206,762,631,309	TX	6	512	2,148,327,200	31,564,000	111,616,000	0	0	0	0	0	204,603,261,900	0.00	0.00	2,179,891,200	0	0	0	0	0	1.05	0.00	0.00	
AH1_1	DDE04	群益台灣ESG低碳50ETF基金	2023/2/24	14,092,604,107	TX	6	26	109,318,200	1,379,400	5,668,000	0	0	0	0	0	13,983,186,690	0.00	0.00	110,697,600	0	0	0	0	0	0.79	0.00	0.00	
AH1_1	DDE05	群益台灣半導體收益ETF基金	2023/5/29	9,084,532,811	TE	6	42	185,145,600	2,493,600	11,466,000	0	0	0	0	0	8,917,906,500	0.00	0.00	187,639,200	0	0	0	0	0	2.07	0.00	0.00	
AH1_1	DDE06	群益台灣科技高息成長ETF基金	2024/4/29	6,790,424,670	TX	6	55	235,184,200	-1,016,200	11,990,000	0	0	0	0	0	6,542,754,050	0.00	0.00	234,168,000	0	0	0	0	0	3.45	0.00	0.00	
AA1	DD002	馬拉松基金	1996/8/20	10,890,385,002												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA1	DD003	長安基金	1998/2/19	1,765,455,554												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA1	DD005	創新科技基金	1999/6/5	5,157,230,020												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA1	DD006	店頭市場基金	1997/2/13	4,423,655,472												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AB1	DD007	真善美基金	1999/11/19	929,431,906												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AB1	DD009	平衡王基金	2000/10/16	1,211,631,797												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA1	DD010	中小型股基金	1996/2/12	2,960,421,294												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AB1	DD011	安家基金	2004/11/19	385,512,578												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA1	DD017	奧斯卡基金	2005/10/25	1,005,492,263												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA1	DD024	荔茉美基金	2006/5/25	1,706,422,141												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AD2	DFM01	人民幣貨幣市場基金	2014/10/30	245,776,751												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA2	DFO17	華夏盛世基金	2009/12/22	4,038,352,996												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA2	DFO23	印度中小基金	2011/6/8	10,738,883,946												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA2	DFO25	大中華雙力優勢基金	2011/12/14	293,870,197												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA2	DFO30	全球關鍵生技基金	2013/12/25	800,473,660												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA2	DFO32	美國新創亮點基金	2013/12/25	1,215,678,114												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA2	DFO34	中國新機會基金	2014/3/26	3,493,135,595												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				
AA2	DFO36	工業國人息基金	2014/6/25	177,773,202												0	0.00	0.00			0		0.00	0.00				

群益證券投資信託股份有限公司
基金從事證券相關商品交易彙總表(保本型基金以外之其他類型基金適用)
2024年5月

基金 類型 代號	基金代號	基金名稱	基金成立日期	基金淨資產價值	期貨(或選擇權) - Swap、OTC證券相關商品 種類 (註2)	期貨(或選擇 權) - Swap、OTC 證券相關商品 契約價值或 名目本金	期貨(或選擇 權) - Swap、OTC 證券相關商品 契約價值或 名目本金	期貨(或選擇 權) - Swap、OTC 證券相關商品 未實現損益	期貨(或選擇 權) - Swap、OTC 證券相關商品 保證金金額	為避險需要						為增加投資效率						投資於任 何公債 票證淨 值(註8)	投資於任 何公債 票證淨 值(註8)	投資於任 何公債 票證淨 值(註8)	
										賣出選 擇權買 權之總 (名目)價 值(註 9)	Swa p、 OTC 證券 相關 商品 之總 (名 目)價 值(註 10)	基金所持 有對應 證券總市 值之比 例 (註4)	(A)+(B) +(C)+(D) 占基金 淨資 值之 比例 (註5)	(A)+(B) +(C)+(D) 占基金 淨資 值之 比例 (註5)	買進選 擇權買 權之總 (名目)價 值(註 11)	買進選 擇權買 權之總 (名目)價 值(註 12)	(A)+(B) +(C)+(D) 占基金 淨資 值之 比例 (註5)	Swap、 OTC 證券 相關 商品 之總 (名 目)價 值(註 13)	可相 互沖 抵之 未沖 銷多 空頭 部位 數量 (註6)	(E)+(F)+(G) +(H)+(I) +(J)+(K) 占基金 淨資 值之 比例 (註5)	(E)+(F)+(G) +(H)+(I) +(J)+(K) 占基金 淨資 值之 比例 (註5)	(E)+(F)+(G) +(H)+(I) +(J)+(K) 占基金 淨資 值之 比例 (註5)			
AE2 3	DFO43	環球金綻雙資基金	2015/1/21	1,440,959,142								0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00		
AH2 1	DIE01	群益深証中小100基金	2015/11/12	1,234,348,292	富時中國A50指期貨202406FTSE China A50 Index Futures202406	6	99	41,084,528	-1,432,177	2,293,434	0	0	0	1,189,445,550	0.00	0.00	39,652,351	0	0	0	3.21		0.00	0.00	
AH2 1	DIE02	那斯達克生技基金	2017/1/9	226,106,056									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 5	DIE03	道瓊美國地產ETF基金	2017/10/20	700,171,867									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE04	15年期以上電信公司債ETF基 金	2017/12/8	54,743,853,022									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE05	15年期以上科技公司債ETF基 金	2017/12/8	52,220,667,458									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE06	10年期以上金融債ETF基金	2017/12/8	103,505,046,587									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE07	15年期以上高評等公司債ETF基 金	2018/10/15	39,573,330,849									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE08	15年期以上公用事業公司債 ETF基金	2018/10/15	6,117,320,260									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE09	15年期以上新興市場主權債 ETF基金	2018/10/15	40,910,248,283									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE10	25年期以上美國政府債券ETF基 金	2018/12/5	35,907,458,443									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE12	15年期以上A級美元公司債 ETF基金	2019/3/27	53,304,147,035									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE13	15年期以上AAA-A醫療保健業 ETF	2019/3/27	148,346,856									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE14	7年期以上中國政策性金融債 ETF基金	2019/3/27	1,299,585,678									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE15	0-1年期美國政府債券ETF基 金	2019/10/8	191,504,905									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE16	1-5年期投資等級公司債ETF基 金	2019/10/8	179,878,550									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AH2 2	DIE17	ESG20年期以上BBB級等債ETF基 金	2023/11/27	163,554,218,817									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AE2 3	DIO01	多重資產組合基金	2005/7/11	992,713,950									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AE2 2	DIO02	多重收益組合基金	2006/3/15	62,421,117									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AB2	DIO03	亞太新趨勢平衡基金	2006/9/1	593,867,801									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AA2	DIO04	新興金鑽基金	2007/2/12	612,236,450									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AA2	DIO05	東方盛世基金	2009/7/29	389,207,145									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AA2	DIO06	印巴雙星基金	2010/4/20	794,185,173									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AE2 2	DIO08	多利策略組合基金	2010/11/16	118,650,836									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	
AB2	DIO53	中國金采平衡基金	2015/6/2	207,539,628									0	0.00	0.00				0		0.00		0.00	0.00	

群益證券投資信託股份有限公司
基金從事證券相關商品交易彙總表(保本型基金以外之其他類型基金適用)
2024年5月

基金 類型 代號	基金代號	基金名稱	基金成立日期	基金淨資產價值	期貨(或選擇權) - Swap、OTC證券相關 商品 種類 (註2)	期貨(或選擇 權) - Swap、 OTC 證券相 關商品 契約價值或 名目本金 (註3)	期貨(或選擇 權) - Swap、OTC 證券相關商品 未實現損益	期貨(或選擇 權) - Swap、OTC 證券相關商品 保證金金額	為避險需要						為增加投資效率						投資於任 一公司股 票發行之有價 證券總額、買 賣總額、其總 額與該公司股 票選擇權權 利價值之比 例	未沖 銷多 空頭 部位 數量	
									賣出選 擇權賣 權之總 (名目) 價值 (B)	買進選 擇權買 權之總 (名目) 價值 (C)	Swap 、OTC 證券相 關商品 之總 (名目) 價值 (D)	基金所持 有相對應 債券總市 值之比例 (註4)	(A)+(B)+ (C)+(D) 占基金 淨資 值之 比例 (E)	未沖銷多頭 部位之 期貨契約總 市值 (註5)	買進選 擇權買 權之總 (名目) 價值 (F)	賣出選 擇權賣 權之總 (名目) 價值 (G)	(A)+(B)+(C) 占基金 淨資 值之 比例 (H)	Swap 、OTC 證券相 關商品 之總 (名目) 價值 (I)	可相 互沖 抵之 未沖 銷多 空頭 部位 數量 (J)	(E)+(F)+(G) 占基金 淨資 值之 比例 (K)	(E)+(F)+(G) 占基金 淨資 值之 比例 (L)	未沖 銷多 空頭 部位 數量 (M)	
AA2	DIO65	東協成長基金	2011/3/22	1,310,678,888									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AA2	DIO74	大印度基金	2016/3/22	1,236,261,252									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AG	DIO77	全球地產入息基金	2016/5/31	340,209,590									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AB2	DIO83	金選報酬平衡基金	2016/9/12	191,106,542									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AA2	DIO90	全球特別股收益基金	2017/6/21	622,021,924									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AC2 3	DIOD5	全球優先順位非投資等級債 券基金	2018/4/30	2,973,207,949									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AJ2	DIOF4	潛力收益多重資產證券投資 信託基金	2018/12/5	14,815,890,640									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AE2 3	DIOG6	全民成長樂退組合基金	2019/7/23	8,695,431,248									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AE2 3	DIOH4	全民優質樂退組合基金	2019/7/23	3,365,888,274									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AC2 1	DIOI0	全球策略收益金融債券基金	2019/10/8	4,443,235,604									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AE2 2	DIOI2	全民安穩樂退組合基金	2019/7/23	460,888,786									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AA2	DIOL4	智慧聯網電動車基金	2022/12/5	723,765,595									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AJ2	DION0	優化收益成長多重資產基金	2023/9/21	3,765,901,277									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00
AC2 3	DIOO2	時機對策非投資等級債券基 金	2024/3/14	7,034,206,694									0	0.00	0.00			0		0.00		0.00	0.00

註1：依據金管會107年8月28日金管證投字第107032656號公告修訂。

註2：期貨或選擇權種類以台灣期貨交易所專用之英文代碼為準，惟個股選擇權之台灣期貨交易所專用英文代碼之第三碼一律為O，如為國外期貨(或選擇權) - Swap、OTC證券相關商品，請填寫其中文及英文名稱。

註3：如為國外期貨(或選擇權) - Swap、OTC證券相關商品，契約內容、未沖銷多空頭部位數量、契約價值(名目本金)、未實現損益、保證金帳戶總金額等各欄位均應填寫。(為避免類似法國興業銀行期貨交易員金融弊案發生)

註4：基金「為避險需要」 - (A)+(B)+(C)+(D)占基金所持有相對應有價證券總市值之比例，不得超過100%。若該比例超過100%，則超過部份屬「為增加投資效率」部位，應計入(B)欄位計算。

註5：(J)欄位之計算說明，舉例，在符合沖抵原則下(Ex：均為台指)：若(J)欄位為 10,000,000，(山)欄位為 8,000,000，(則)欄位應為 8,000,000。若(山)欄位為 9,000,000，(出)欄位為 11,000,000，則(J)欄位應為 9,000,000。

另例：不完全符合沖抵原則之情形：當(J)欄位為20,000,000(其中買進台指選擇權權利為11,000,000、買進電子選擇權權利為9,000,000)；(H)欄位為20,000,000其中超過該基金所持相對應有價證券總市值之台指期貨空頭部位為7,000,000、金融期貨空頭部位為13,000,000，則(J)欄位應為7,000,000。只能計算符合沖抵原則之部位。

註6：(K)欄位所計算之比例，不得為負值。若為負值(或 小於0)，表示(J)欄位計算錯誤。

註7：如無從事股票選擇權或期貨期貨，則無須填寫。如有，其填寫格式為：公司名稱、比例(Ex：台積電、9%)。

群益證券投資信託股份有限公司
 基金從事國外期貨、選擇權及證券相關商品交易彙總表
 2024年5月份交易累積量

(第1頁/共1頁)

基金 代號	基金名稱	從事國外期貨交易所之累積交易						從事非在國外期貨交易所 (店頭市場OTC)之累積交易			
		期貨交易所 (中文／英文)	期貨或選擇權商品名稱 (中文／英文)	買入 口數	賣出 口數	合計 口數	OTC證券相關商品 之交易對手 (中文／英文)	OTC證券相關商品名稱 (中文／英文)	買入總(名目)價值 (原交易幣別)	賣出總(名目)價值 (原交易幣別)	合計總(名目)價值 (原交易幣別)
AF	2028 REVERSO美元保 本基金						法國外貿銀行台北 Natixis Taipei	NATIXIS RVS 20281120NATIXIS RVS 20281120(USD)	0.00	200,000.00	200,000.00
AF	2028 REVERSO美元保 本基金						法國外貿銀行台北 Natixis Taipei	2028年到期選擇權(USD)	0.00	200,000.00	200,000.00
AH21	群益深証中小100基金	新加坡國際金融交易所 Singapore Exchange LTD	富時中國A50指數期貨202406FTSE China A50 Index Futures202406	129	30	159					
AH21	群益深証中小100基金	新加坡國際金融交易所 Singapore Exchange LTD	富時中國A50指數期貨202405FTSE China A50 Index Futures202405	0	129	129					

證券投資信託股份有限公司
保本型基金從事證券相關商品交易彙總表
年 月

單位：新臺幣元(第1頁/共1頁)

基金類型代號	基金代號	基金名稱	基金成立日期	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品種類 (註2)	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品 契約內容 (註3)	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品 未沖銷多空頭部位 數量	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品 契約價值 或 名目本金	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品 未實現損益 保證金額	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品 未沖銷多頭部位 之未保本之本金 (A)	基金資產中之利 息 (註4)	未沖銷多頭部位 之期貨契約總市 值 (B)	買進選擇 權買權之總 價值 (註5)	賣出選擇 權賣權之總 價值 (C)	Swap、OTC證券 相關商品之總 價值 (D)	(A)+(B)+ (C)+(D)占 基金淨資 產價值之 比例	未沖銷空頭部位 之期貨契約總市 值 (E)	買進選擇 權買權之總 價值 (F)	賣出選擇 權賣權之總 價值 (G)	(E)+(F)+ (G)占基 金淨資 產價值之 比例	未沖銷之 買進選擇 權買權之 總價值 占基金總額 比例	持有一以我國證券、 證券組合或股價指 數為標的之國內外 交易所以期貨或選 擇權交易，其未沖 銷期貨契約總市 值及選擇權總市 值(名目價值之總 數，國內期貨市場 部分占據外期貨市 場部分之比例	持有未沖銷部 位之各類契約 數為標的之國內外 交易所以期貨或選 擇權交易，其於契約到 期日算加總後之最大可 能損失占該基金 資產中之利息 或未保本之本 金之比例	備註
AF	DIO39	2028 REVERSO美元保本基金	2018/11/16	2028年到期選擇權(USD)	2028年到期選擇權(USD)	4,487,511	145,485,107	9,180,110	0	48,891,263					290,970,214	170.54			20.72	25.97			
AF	DIO39	2028 REVERSO美元保本基金	2018/11/16	NATIXIS RVS 20281120NATIXIS RVS 20281120(USD)	NATIXIS RVS 20281120NATIXIS RVS 20281120(USD)	1	145,485,107	-16,788,981	0	48,891,263					290,970,214	170.54			20.72	25.97			

註1：依據金管會107年8月28日金管證投字第1070326456號公告修訂。

註2：期貨或選擇權種類以台灣期貨交易所專用之英文代碼為準，惟個股選擇權之台灣期貨交易所專用英文代碼之第三碼一律為O。如為國外期貨(或選擇權)、Swap、OTC等證券相關商品，請填寫其中文及英文名稱。

註3：如為國外期貨(或選擇權)、Swap、OTC等證券相關商品，契約內容、未沖銷多空頭部位數量、契約價值(名目本金)、未實現損益、保證金帳戶總金額等各欄位均應填寫。

註4：基金資產中之利息為保本型基金因保本操作之需要，以定期存款存放於金融機構，所衍生之利息，取整數位。

註5：未保本之本金為保本型基金所定保本比率外之本金，取整數位。