

凱基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)
 2021年03月

單位：新臺幣元

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	2) 避險需要							2) 增加投資效率							持有以我國證券、債券組合或股票指數為標的之國內外交易所之期貨或選擇權交易，其未沖銷期貨與選擇權總部位之合計數，國內期貨市場部分占國外期貨市場部分之比例	投資於任一公司發行之存摺證券總額，其選擇權買進及賣出該公司股票選擇權價值之總(名目)價值與該公司未沖銷多頭部位之合計數，國內期貨市場部分占國外期貨市場部分之比例	未沖銷之買進選擇權之總(名目)價值占基金淨資產價值之比例	未沖銷之賣出選擇權之總(名目)價值占基金淨資產價值之比例	於任一區間市場交易對手承擔淨額(不含匯率風險)占該基金淨資產價值之比例	備註									
					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	期貨(或選擇權) - Swap - OTC 證券相關商品 保證金金額	未沖銷空頭部位之期貨契約總部位價值(A)	買進選擇權價值之總(名目)價值(B)	賣出選擇權價值之總(名目)價值(C)	Swap - OTC 證券相關商品之總(名目)價值(D)	基金所有相對應有價證券總部位價值	(A)+(B)+(C)+(D)占基金淨資產價值之比例	(A)+(B)+(C)占基金淨資產價值之比例	未沖銷多頭部位之期貨契約總部位價值(E)							買進選擇權價值之總(名目)價值(F)	賣出選擇權價值之總(名目)價值(G)	(A)+(B)+(C)+(D)占基金淨資產價值之比例	(E)+(F)+(G)+(H)占基金淨資產價值之比例	(I)+(J)+(K)占基金淨資產價值之比例				
AA1	DW001	凱基開創基金	2001/10/08	319,446,754			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AA1	DW019	凱基台灣科五門基金	2009/09/03	799,104,495			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AD1	DWA01	凱基凱安貨幣市場基金	2002/06/25	4,276,840,496			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AA2	DW04	凱基台灣天下基金	2007/05/08	357,766,622			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AA2	DW10	凱基新興市場中小基金	2011/08/05	290,053,486			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AA2	DW13	凱基雙環趨勢基金	2012/09/13	128,109,424			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AA2	DW19	凱基亞洲匯城磚基金	2015/06/15	252,464,800			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AA2	DW22	凱基利經商機基金	2016/07/11	165,037,132			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AA2	DW28	凱基羅況及長期美債基金	2017/05/02	342,150,459			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AE21	DW07	凱基新興趨勢ETF組合基金	2010/08/09	131,936,240			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH21	凱基3至10年期中高收益債券ETF基金	2018/09/05	25,501,981,886			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH22	凱基10年期以上新興市場BBB美元平價債及高利債債券ETF基金	2018/09/05	18,194,464,888			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH23	凱基10年期以上利債券ETF基金	2018/09/05	5,255,421,399			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH24	凱基15年期以上AAA至A級美元公債債券ETF基金	2019/01/29	25,456,066,770			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH25	凱基20年期以上美金債券ETF基金	2019/01/29	21,829,397,731			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH26	凱基25年期以上美國公債ETF基金	2019/01/29	12,242,327,750			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH27	凱基15年期以上美元投資等級債券ETF基金	2019/05/01	4,474,728,231			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH28	凱基15年期以上美元醫療保險及護理債券ETF基金	2019/05/01	548,085,187			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH29	凱基20年期以上AAA至AA級大型美元公債債券ETF基金	2019/05/31	823,803,494			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH22	DH30	凱基1至3年期美國公債ETF基金	2019/12/30	137,310,947			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
AH1	DW20	凱基臺灣多元收益多項資產基金	2019/08/05	1,972,303,699			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%			
					AAFL USAAFL IS	5	56	188,533	35,150																						AAFL US - 3.68%		
					ACN USACN US	5	3	32,925	-24,308																						ACN US - 0.6%		
					ADHE USAIHE IS	5	4	83,311	-28,645																						ADHE US - 1.07%		
					AISK USAISK IS	5	3	33,381	-12,411																						AISK US - 0.68%		
					ALL USALL US	5	8	49,073	9,130																						ALL US - 0.74%		
					AMZN USAMZN US	5	1	120,243	23,338																							AMZN US - 2.64%	

凱基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)
 2021年03月

單位：新臺幣元

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	為總檢點要											為增加投資效率						持有以我國證券、證券組合或股票價值為標的之國內外交易所之期貨或選擇權交易。其未沖銷期貨及選擇權契約總名目價值	投資於任一公司發行之外幣證券總額，買進該公司股票選擇權及賣出該公司股票選擇權之總名目價值	未沖銷之買進選擇權之總名目價值	未沖銷之賣出選擇權之總名目價值	於任一市場之買進對沖之買進淨資產價值	備註										
					期貨(或選擇權)·Swap·OTC證券相關商品 (註2)	期貨(或選擇權)·Swap·OTC證券相關商品 (註3)	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	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	期貨(或選擇權)·Swap·OTC證券相關商品	未沖銷空頭部位之期貨契約總市值(A)	買進選擇權之總名目價值(B)	賣出選擇權之總名目價值(C)	Swap·OTC證券相關商品之總名目價值(D)	基金所持有相對總淨資產價值	(A)+(B)+(C)+(D)占基金淨資產價值之比	未沖銷多頭部位之期貨契約總市值(E)	買進選擇權之總名目價值(F)	賣出選擇權之總名目價值(G)	(A)+(B)+(C)+(D)占該基金淨資產價值之比							可相互沖抵之未沖銷多頭部位之期貨契約總市值(H)	(E)+(F)+(G)+(H)占該基金淨資產價值之比	(註6)	(註7)	未沖銷之買進選擇權之總名目價值占該基金淨資產價值之比	未沖銷之賣出選擇權之總名目價值占該基金淨資產價值之比	於任一市場之買進對沖之買進淨資產價值占該基金淨資產價值之比			
					MSFT US	15	151,928	0																													
					NEM US	13	48,959	1,855																													
					NFLX US	3	70,614	11,983																													
					NUE US	8	73,039	6,163																													
					NVDA US	1	36,234	-22,397																													
					PG US	7	39,744	4,593																													
					PGR US	7	53,924	-11,983																													
					PRNS US	9	39,544	-28,502																													
					PM US	10	26,534	3,138																													
					PWR US	7	17,975	-21,969																													
					R US	5	27,390	-32,525																													
					RS US	4	17,119	-29,216																													
					SCHW US	22	69,673	-13,809																													
					SPGI US	3	54,780	-3,424																													
					TGT US	5	34,665	-23,823																													
					TESLA US	4	152,926	60,372																													
					TSN US	9	26,962	6,676																													
					UNH US	4	59,344	-10,271																													
					UPS US	8	86,734	-73,039																													
					VIRT US	40	108,418	-28,511																													
					XOM US	22	42,055	-1,235																													
AJ2	DMDA0	凱基未來世代醫療科技多項資產基金	2021/03/02	1,520,211,217		0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%								0.00%	0.00%	0.00%
AC21	DRC32	凱基六年到期新興市場債券基金	2018/03/02	1,351,560,911		0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%								0.00%	0.00%	0.00%
AC21	DRC34	凱基2024到期新興市場債券基金	2018/09/01	4,874,190,887		0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%								0.00%	0.00%	0.00%
AC21	DRC36	凱基2025到期新興市場債券基金	2019/01/22	2,139,641,628		0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%								0.00%	0.00%	0.00%
AC21	DRC38	凱基2025到期新興市場債券基金	2019/06/10	2,988,525,822		0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%								0.00%	0.00%	0.00%
AC21	DRC55	凱基2025到期新興市場債券基金	2019/10/15	6,032,221,006		0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%								0.00%	0.00%	0.00%

凱基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)
2021年03月

單位：新臺幣元

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 契約內容 (註3)	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 保證金額	為避險需要					為增加投資效率					持有以我國證券、證券組合或報價指數為標的之國內外交易所之期貨或選擇權交易，其未沖銷期貨與約總部位及選擇權契約總(名目)價值 (註6)	投資於任一公司發行之有價證券總額，實地該公司股權選擇權及持有該公司未沖銷多頭部位之個別期貨與約總部位占該基金淨資產價值之比例 (註7)	未沖銷之實地選擇權之種類 金總額占基金淨資產價值之比例	未沖銷之實地選擇權(名目)價值占基金淨資產價值之比例	於任一市場交易對手承擔之風險淨額(不含匯率避險交易)占基金淨資產價值之比例	備註			
										未沖銷空頭部位之期貨與約總部位 (A)	買進選擇權之總(名目)價值 (B)	賣出選擇權之總(名目)價值 (C)	Swap·OTC證券相關商品之總(名目)價值 (D)	基金所持有相對應有價證券總值 (註4)	(A)+(B)+(C)+(D)占基金淨資產價值之比例 (註4)	未沖銷多頭部位之期貨與約總部位 (E)	實地選擇權價值之總(名目)價值 (註4)	賣出選擇權價值之總(名目)價值 (註4)	(A)+(B)+(C)+(D)占該基金所持有相對應有價證券總值之淨額 (註4)							Swap·OTC證券相關商品之總(名目)價值 (註4)	可相互沖抵之未沖銷多、空頭部位之契約總部位 (註5)	(E)+(F)+(G)+(H)+(I)+(J)占基金淨資產價值之比例 (註6)
AC21	DIO63	凱基2025定期新開市場債券基金	2020/03/12	1,208,696,354			0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%		
AC21	DIO68	凱基全球ESG永續高收益債券基金	2020/08/04	2,809,505,920			0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%		
AC21	DIO82	凱基新興亞洲永續環境債券基金	2020/09/29	1,137,021,684			0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%		
H	DIO14	凱基寶利基金	2007/05/31	472,972,756			0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%		
H	DIO15	凱基富麗策略基金	2007/07/25	774,170,225			0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%		
H	DIO18	凱基領富基金	2006/06/27	53,365,158			0	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0.00%		
H	DIO22	凱基台灣特選債券基金	2020/08/04	1,149,121,387			650	65,000,000	2,682,000	0	0	0	0	0	0.00%	0.00%	0	61,836,000	0	0	0	0	0	5.38%	0.00%	1.12%	0.00%	0.00%

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

註2：期貨或選擇權價值類以台灣期貨交易所專用之英文代碼為準，惟台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0，如為國外期貨(或選擇權)·Swap·OTC證券相關商品，請填對其中文及英文名稱。

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、保證金額等欄位均應填寫。(為避免類似法調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(H)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(E)欄位為 10,000,000，(H)欄位為 8,000,000，則(J)欄位應為 8,000,000。若(G)欄位為 9,000,000，(H)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(E)欄位為20,000,000(其中買進台指選擇權價值為11,000,000，買進電子選擇權價值為 9,000,000)；(H)欄位為20,000,000(其中超過該基金所持有相對應有價證券總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，只統計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個股期貨，則無須填寫。如有，其填寫格式為：公司名稱、比例(Ex：台積電、9%)。

總經理：



期貨部門主管：

陳思琦

覆核：

吳佳琦

製表：

張佩真

公司章：

