

NEWS RELEASE

發稿日期：2023 年 1 月 11 日

首檔“零”投資手續費 ETN 策元大加權策略 N 陪你過好年

台灣首檔零投資手續費 ETN-「策元大加權策略 N」(股票代號:02001S)，發行三年期，每年配息一次，已在 2022 年 12 月 5 日掛牌上市，1 月 9 日價格約為新臺幣(下同)4.95 元。

「策元大加權策略 N」，是全市場第一檔不收投資手續費的 ETN，其報酬率與所連結指數完全同步，因為零投資手續費，就像一檔不收管理費的 ETF，不管是抱股過年或長期投資，都不用擔心每天會從淨值中扣除持有成本影響投資績效。

「策元大加權策略 N」，連結「加權指數掩護性臺指買權價外 5%報酬指數」(IR0129)的表現。採用法人最愛的「掩護性買權」策略：投資臺股大盤+賣出價外臺指買權。此策略最大的優點是：享有大盤的報酬率外，只要「每個月加權指數漲幅小於 5%或者是下跌」，還可以多賺一筆賣出買權的權利金收入。

舉例來說，此 ETN 於 2022/12/5 掛牌時，投資策略賣出的選擇權契約為 12 月履約價 15,300 的臺指買權，結算價為 99 點；在 2022/12/21 結算時，選擇權的結算價值為 0 點，賣出選擇權的獲利高達 99 點。因為多賺了這 99 點，僅僅半個月的期間內，ETN 的績效就高於加權報酬指數達 0.63%。(12/5 加權指數點數為 14,980，選擇權價格為 99 點，所以成本為 14,881 點。99 除以 14,881 點，獲利約為 0.6% ~ 0.7%)

「掩護性買權」策略的特色，就是藉由「期權」提高投資勝率。在股市盤整時可以多賺，下跌時損失減少。對喜歡投資大盤的投資人而言，是少數能抵抗「慢熊」、「慢牛」盤勢耐震抗跌的聰明策略。但是當加權指數快速上漲、單月漲幅超過 5%時，當月指數的績效就可能落後於大盤。

策元大加權策略 N (02001S)，有三大特色：第一，零投資手續費。第二，每年固定在 11 月除息，年年有穩定領息的機會，息值計算除了大盤的現金殖利率外，更包含臺指價外買權的收益。第三，低單價好入手。

元大證券提醒，期權策略型 ETN 所追蹤的標的指數，由現貨、期貨、選擇權或相

NEWS RELEASE

關指數結合而成，複雜程度比較高。投資人買賣前，應先簽具風險預告書，並符合投資人「適格性」方可交易。

為推廣元大 ETN 的商品，元大證券近日推出「買就抽千元禮券」活動，相關商品及抽獎活動資訊，請至元大 ETN 網查詢。

策元大加權策略 ETN 小檔案

證券代號	證券名稱	發行價格 (元)	發行數量(張)	投資手續費 率(年)	配息/不配 息
02001S	策元大加權策略 N	5	400,000	0%	配息
連結指數名稱		提前到期條件	除息日	上市日	到期日
加權指數掩護性臺指買權價外 5%報酬指數 (代號：IR0129)		指標價值 <1 元	每年十一月第 三個營業日	2022/12/5	2025/12/4

聲明：元大證券股份有限公司業已自「臺灣指數公司」取得使用「加權指數掩護性臺指買權價外 5%報酬指數」之授權。