

中信美國市政債 (00847B)

追蹤指數：彭博美國長天期政府及高評級市政債券指數

客製化指數與傳統指數之差異及相關差異導致之風險

(一)利率風險：指數成分券的組成是以 20 年期以上美國政府及市政機構發行之債券為主，相較於一般公司債指數 20 年期以上債券佔比約兩成有更長的存續期間，價格波動受利率波動影響大。

(二)特定產業風險：指數成分券的組成是以美國政府及美國市政相關機構所發行之美元公司債為主，相較於一般公司債指數投資範圍涵蓋全產業，各產業利差收斂與發散的情形不同可能導致標的指數的期間表現與一般公司債指數表現出現背離。

客製化指數風險數據揭露

| | 彭博美國長天期政府及高評級市政債券指數 | 傳統市值型指數 (ML 美國投資級債券指數) |
|-------|---------------------|---------------------------|
| 年化波動度 | 11.67% | 6.76% |

資料整理日期：2023/12/29