

中信新興亞洲債 (00848B)

追蹤指數：彭博新興亞洲(不含中國)美元精選綜合債券指數

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新興亞洲國家發行之長天期債券為主，相較於一般新興債指數 10 年期以上債券佔比約三成有更長的存續期間，價格波動受利率波動影響大。

(二)特定區域風險：指數成分券的組成是以涉險國家為新興亞洲所發行之美元債為主，相較於一般新興債指數投資範圍涵蓋全球新興市場，各區域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新興債指數表現出現背離。

客製化指數風險數據揭露

	彭博新興亞洲(不含中國)美元精選綜合債券指數	傳統市值型指數 (JP 新興市場公司債券指數)
年化波動度	7.48%	5.98%

資料日期：2023/12/29