

## 中信 EM 主權債 0-5 (00849B)

追蹤指數：ICE 新興市場 0-5 年期美元政府債券指數

### 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國家發行之短天期債券為主，相較於一般新興債指數有更短的存續期間，價格波動受利率波動影響小。

(二) 信用評級風險：指數成分券的組成是以 BB-評級以上美元主權債為主，相較於一般新興債指數投資範圍涵蓋全信用評級，各信用評級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主權債指數表現出現背離。

### 客製化指數風險數據揭露

	ICE 新興市場 0-5 年期 美元政府債券指數	傳統市值型指數 (JP 新興市場主權債券指數)
年化波動度	2.18%	6.51%

資料整理日期：2023/12/29