

中信投資級公司債 (00862B)

追蹤指數：彭博 20 年期以上 BBB 級美元公司債券指數

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 年期以上美元公司債為主，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)信用評級風險：指數成分券的組成是以信用評級介於 BBB+到 BBB-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投資等級，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公司債指數表現出現背離。

客製化指數風險數據揭露

	彭博 20 年期以上 BBB 級美元公司債券指數	傳統市值型指數 (ML 美國投資級債券指數)
年化波動度	14.77%	6.76%

資料整理日期：2023/12/29。