

## 中信關鍵半導體 (00891)

追蹤指數：ICE FactSet 臺灣 ESG 永續關鍵半導體指數

### 客製化指數與傳統指數之差異及相關差異導致之風險

(一)特定產業風險：與傳統市值型指數相比，傳統市值型指數涵蓋全部產業之上、中、下游供應鏈，其較為多元分散，相較之下，(1)指數成分組成以半導體為主題，訂定特定投資策略，具產業景氣循環及類股可能較為集中之風險，並且，(2)一般而言，該指數的波動度將略高於傳統市值型指數，此外，(3)若半導體業景氣弱於一般上市櫃公司之平均水平，亦可能導致標的指數的期間表現不若傳統市值型指數。

(二)ESG 選股風險：本指數除以半導體為主題，更進一步將 ESG 具投資環境、社會與治理(ESG)相關主題基金之風險納入選股考量，因而(1)標的指數之成分證券價格波動將影響標的指數的走勢，當標的指數的成分證券價格波動劇烈或變化時，標的指數亦承受大幅波動的風險。此外，(2)指數公司在基於 ESG 標準評估某一股票或發行公司時，須依賴第三方 ESG 評鑑機構取得的資料及數據來評估某一有價證券或發行人，而該等資料及數據可能並不完整、不準確或無法取得，而存在依賴該等資料或數據評估相關之風險。

### 客製化指數風險數據揭露

	ICE Factset 臺灣 ESG 永續關鍵半導體指數	傳統市值型指數 (台灣加權股價指數)
年化波動度	25.00%	16.48%

資料日期：2023/12/29