

中信小資高價 30 (00894)

追蹤指數：臺灣指數公司特選小資高價 30 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) 特定產業及類股集中風險：與傳統市值型指數相比，傳統市值型指數涵蓋科技、金融與傳統三大主要產業類別，其子產業較為多元分散，相較之下，臺灣指數公司特選小資高價 30 指數訂定特定投資策略(以高股價及股價增長動能為主題)，產業景氣循環及類股可能過度集中之風險，多數投資於科技產業，若於金融與傳統產業表現優於科技產業期間，亦可能導致標的指數的期間表現與傳統市值型指數表現出現背離。

(二) 周轉率風險：標的指數為半年度(於每年五、十一月進行成分股審核)調整成分股與權重再平衡，而傳統市值型指數則為每季進行成分股增刪調整與權重再平衡，因此臺灣指數公司特選小資高價 30 指數於半年度調整期間可能出現周轉率高於傳統市值型指數的情況發生。

客製化指數風險數據揭露

	臺灣指數公司特選 小資高價 30 指數	傳統市值型指數 (台灣加權股價指數)
年化波動度	21.69%	16.48%

資料日期：2023/12/29