

中信電池及儲能 (00902)

追蹤指數：ICE FactSet 電池與儲能科技指數

客製化指數與傳統指數之差異及相關差異導致之風險

(一) 產業風險：

本指數採用主題相關營收作為選股邏輯，指數挑選 30 檔全球主要電池生產國家之相關公司，分成電池儲能科技及電池材料與技術兩大領域，而傳統市值型指數的產業較為分散多元，與傳統市值型相比，本指數的產業風險較集中於工業與原物料產業。若相關產業表現不佳或相關需求不振，可能令指數與傳統市值型指數績效表現出現分歧。

(二) 國家風險：

本指數挑選美國、中國、香港、日本、韓國以及中國民國掛牌交易的電池與儲能科技供應鏈相關企業，傳統市值型指數的投資國家較為多元分散，本指數相較於傳統市值型的國家掛牌地更為集中，若投資國家出現政治或經濟出現較大變動時，亦可能影響本基金淨資產價值之表現，可能造成標的指數表現與傳統市值型指數表現出現背離。

客製化指數風險數據揭露

| | ICE 電池與儲能科技指數 | 傳統市值型指數 (MSCI 世界指數) |
|-------|---------------|------------------------|
| 年化波動度 | 25.73% | 14.01% |

資料日期：2023/12/29