

中信臺灣智慧 50 (00912)

追蹤指數：臺灣指數公司特選臺灣上市上櫃智慧 50 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)周轉率風險：標的指數為季度(於每年一、四、七、十月進行成分股審核)調整成分股與權重再平衡，而傳統市值型指數則為每年進行一次成分股增刪調整，每季進行成份股權重再平衡，因此標的指數於季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。

(二)因子投資特性風險：指數成分組成以多因子權值股為主題，訂定特定投資策略，具產業景氣循環及類股可能過去集中之風險，而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，標的指數相對於傳統市值型指數，可能承受較大波動的風險。

客製化指數風險數據揭露

	臺灣指數公司特選臺灣 上市上櫃智慧 50 指數	傳統市值型指數 (台灣加權股價指數)
年化波動度	19.66%	16.48%

資料日期：2023/12/29