

## 中信特選金融 (00917)

追蹤指數：ICE FactSet 特選金融及數據指數

### 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全部金融股產業，其子產業較為多元分散，而本標的指數成分股組成僅投資金融股中涵蓋特定產業結構，如交易所、金融數據、資產管理、銀行及券商相關主題之子產業，訂定特定投資策略，具產業景氣循環及類股可能過度集中之風險。
- (二) 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，因此本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。
- (三) 國家風險：標的指數具有成分股掛牌地國家限制(僅限於美國、英國、德國、法國、香港，共五個國家中十個交易所之個股)，因此相較於傳統市值型指數若僅投資於單一國家別掛牌之金融指數較為分散，但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，亦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 FactSet 特選<br>金融及數據指數 | 傳統市值型指數<br>(MSCI 金融股指數) |
|-------|---------------------------|-------------------------|
| 年化波動度 | 17.87%                    | 16.49%                  |

資料日期：2023/12/29