

中信上櫃 ESG 30 (00928)

追蹤指數：臺灣指數公司特選上櫃 ESG 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)規模因子偏離風險：標的指數成分股以上櫃市場為母體，類股輪動或市況有較大變動時，可能造成大型股與中小型股表現之偏離風險。

(二)周轉率風險：標的指數為季度(於每年三、六、九、十二月進行成分股審核)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。

(三)ESG 因子投資風險：指數成分組成以上櫃 ESG 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，且納入 ESG 具投資環境、社會與治理(ESG)相關主題基金之風險，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，標的指數可能承受較傳統市值型指數較大的波動風險。

客製化指數風險數據揭露

	臺灣指數公司特選 上櫃 ESG 30 指數	傳統市值型指數 (櫃買中心股價指數)
年化波動度	15.76%	13.58%

資料日期：2023/12/29