中信優息投資級債(00948B)

追蹤指數：ICE 15 年期以上已開發市場投資級優化收益ESG 美元公司債券指數

客製化指數與傳統指數之差異及相關差異導致之風險

(一)利率風險：指數成分券的組成是以 15 年期以上美元公司債為主，相較於一般公司債指數 15 年期以上債券佔比約兩成五有更長的存續期間，價格波動受利率波動影響大。

(二)ESG 篩選風險：指數成分券的組成排除「爭議性產業相關分數」> 10 分，與 Sustainalytics ESG Risk Scores ≧ 30 分之美元公司債券，相較於一般公司債指數投資範圍 ESG 風險並未設限，各企業利差收斂與發散的情形不同可能導致標的指數的期間表現與一般公司債指數表現出現背離。

客製化指數風險數據揭露

	ICE 15 年期以上已開發市場投資級優化收益ESG 美元公司債券指數	傳統市值型指數 (ML 美國投資級債券指數)
年化波動度	10.78%	5.33%

註：上表資料期間係統計近 3 年數據，資料整理日期：2025/12/31。