

# 櫃買富櫃 200 指數月報

## 指數簡介

上櫃股票市場即為台灣最具代表性的中小型股票的群聚場所，近年來上櫃公司不論是公司營運成果及股價表現均有目共睹，櫃買中心網羅了 200 家具市值規模且有流動性的上櫃股票全新編製櫃買富櫃 200 指數，提供市場參與者一個觀察台灣中小型股票的最佳指標。

- ◇ 指數基期：107 年 12 月 28 日
- ◇ 成分股家數：198 家(註)
- ◇ 基期點數：5,000 點
- ◇ 成分股市值：2.55 兆元(109.06.30)
- ◇ 審核頻率：每季(1、4、7 及 10 月)
- ◇ 109.06.30 收盤點數：6,801.31

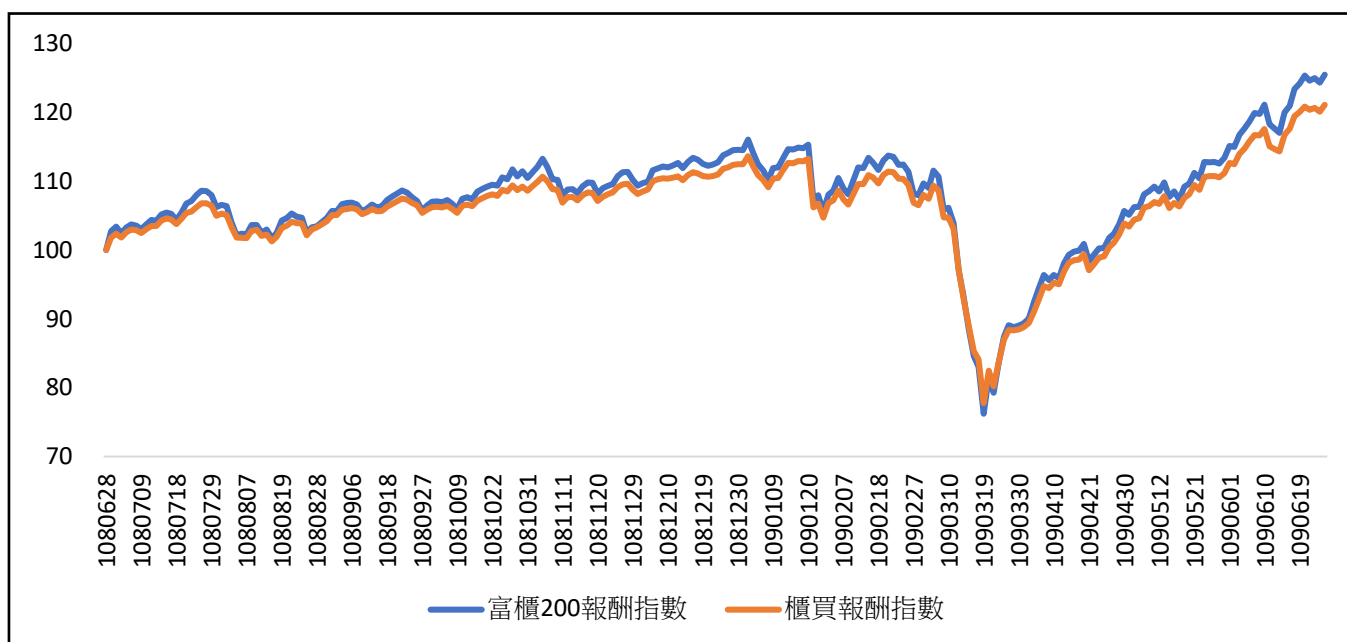
註：部分成分股因終止上櫃而予以刪除，缺額將於七月季審核時遞補。

## 指數編製方式及特色

- 一、每季均進行流動性檢驗，即時反應市場成交趨勢。
- 二、審核市值時設置 20% 之緩衝區間，兼顧指數代表性及降低操作成本。
- 三、具市場代表性：成分股市值涵蓋率約 7 成，成交值涵蓋率約 9 成。
- 四、指數計算方式：以流通量加權。
- 五、富櫃 200 指數之價格指數及報酬指數均每隔 5 秒計算及公布即時指數一次。

## 指數績效

資料期間：108.06.28~109.06.30



期間	1 個月	2 個月	3 個月	1 年	今年迄今
績效	10.65%	18.72%	40.39%	25.42%	9.57%

### 前十大成分股

資料日期：109.06.30

排行	股票代號	股票名稱	產業類別	權重
1	3105	穩懋	半導體業	6.45%
2	6488	環球晶	半導體業	4.48%
3	5347	世界先進	半導體業	3.89%
4	4966	譜瑞-KY	半導體業	3.59%
5	4743	合一	生技醫療	3.57%
6	6121	新普科技	電腦及週邊設備業	3.01%
7	5483	中美晶	半導體業	2.55%
8	8299	群聯電子	半導體業	2.36%
9	6147	頤邦科技	半導體業	2.14%
10	3293	鈦象電子	文化創意業	2.10%
Total				34.14%

### 成分股產業分布

資料日期：109.06.30

產業類別	家數	權重
半導體業	38	41.66%
生技醫療	34	19.09%
電子零組件業	31	7.84%
電腦及週邊設備業	14	6.45%
光電業	12	4.24%
小計	129	79.28%
其他產業	69	20.72%
合計	198	100.00%

### 櫃買富櫃 200 指數相關商品成交資料彙整表

月份	期貨		ETN			權證		
	日均量 (口數)	期末未 銷契約 (口數)	日均量 (單位)	日均值 (元)	上櫃 檔數	日均量 (單位)	日均值 (元)	上櫃 檔數
2020年3月	247	199	394,500	1,762,073	2	618,364	1,139,712	84
2020年4月	471	242	55,350	263,343	2	273,950	254,336	73
2020年5月	217	242	101,450	584,633	2	173,700	194,391	65
2020年6月	552	209	229,500	1,387,595	3	297,300	342,108	42

## 亮點介紹

因應永續及指數化投資熱潮，本中心自去(108)年 3 月 27 日推出富櫃 200 指數後，與臺灣指數公司及中華民國企業永續發展協會（簡稱永續協會）合作於 109 年 6 月 29 日推出首檔以企業社會責任(Corporate Social Responsibility, CSR)為主題之上櫃股票指數-「臺灣指數公司臺灣上櫃企業社會責任指數」(簡稱「上櫃 CSR 指數」)，藉以鼓勵上櫃公司重視並實踐企業社會責任，另期可發行 ETF、ETN、指數權證或基金等指數金融商品，以提供投資人參與永續投資的新管道。

### (一) 編製方式：

1. 自通過流動性檢驗之上櫃股票中，篩選永續風險評鑑分數達 70 分者，並挑選最近 3 個年度之股東權益報酬率皆為正數者之上櫃公司為成分股。
2. 依照永續風險評鑑分數調整權重，並限制個別成分股權重不得超過 20%，前 5 大成分股權重總和不得超過 60%。
3. 指數計算方式：自由流通量加權。
4. 成分股檔數：不固定，約在 40 檔左右。
5. 審核頻率：每年 6 月定審。

### (二) 永續風險評鑑及指數特色：

1. 永續協會為一獨立之專業機構，其評鑑模型係取得美國永續會計準則委員會(Sustainability Accounting Standards Board, 簡稱 SASB)之授權，參考 SASB 標準並結合在地化特性開發而成，永續協會並參酌上市櫃公司於公開資訊觀測站揭示之企業社會責任報告書輔以自行收集公開資訊進行評鑑，而非依賴問卷。
2. 除取得 SASB 授權使用 SASB 標準外，本指數更參考聯合國責任投資原則之建議，以「篩選法」及「整合法」將 ESG 議題納入建構投資組合之一環，例如以評鑑分數(須達 70 分)作為篩選成分股之門檻(篩選法)，以及依永續風險評鑑分數之高低，調高或降低成分股之權重(整合法)。
3. 經回溯測試(2016 年 6 月 24 日至今年 6 月 19 日)，上櫃 CSR 指數績效不論是年化報酬(19.03%)或 Sharpe Ratio(68.91%)均高於櫃買指數(16.76%及 65.09%)，顯示經過評鑑分數及基本面篩選後之成分股，可有效提升投資組合之績效及穩定性；且上櫃 CSR 指數與富櫃 200 指數之相關係數達 85%，故未來以上櫃 CSR 指數之指數化商品已具備有良好的避險工具，值得機構發行人參考。

## 活動專區

### 動畫懶人包



### 圖文懶人包



## 新聞剪輯

### [台灣 50、富櫃 200 四檔夯](#)

2020/6/8 經濟日報

由於新冠肺炎疫情影響趨緩、國際油價回溫，加上國際熱錢回流新興市場，帶動台股集中與櫃買雙市昨（8）日持續勁揚大漲，再創波段反彈新高，表現相當強勢，連動元大台灣 50（0050）、富櫃 200 指數（IX0118）等相關指數型認購權證也紛紛大漲收紅。

### [遇見指數線上講座 五連發](#)

2020/6/8 工商時報

櫃買中心 5 日表示，為了讓投資人於防疫期間也能掌握 2020 下半年投資大趨勢及瞭解富櫃 200 指數之特色，將於 6 月 10 日及 17 日合計推出五場，採線上直播方式舉辦「遇見指數投資大未來投資人講座」，讓投資人不出門也可以完整吸收最新的投資資訊及方法。（觀看路徑：[www.tpex.org.tw](http://www.tpex.org.tw)<<http://www.tpex.org.tw>>，不開放現場參加）。…

### [富櫃 200 鎖定價平](#)

2020/6/9 經濟日報

櫃買市場本波領先集中市場創今年新高，累計今年來累計漲幅達 3.4%，在全球股市名列前茅。法人認為，在資金行情推波助瀾下，櫃買指數有機會持續盤堅向上，建議拉回買進富櫃 200（IX0118）相關權證參與短多行情。…

### [永豐富櫃 200N 15 日掛牌 囊括櫃買 200 檔持股](#)

2020/6/10 經濟日報

台股指數型商品再添生力軍，永豐金櫃買富櫃 200 報酬指數 ETN（020017，簡稱永豐富櫃 200N），下周一（15 日）於證券櫃檯買賣中心正式掛牌交易，永豐金證券這次發行的 ETN（020017）以櫃買富櫃 200 指數為追蹤標的，發行價格 5 元，小資族只要 5000 元就可參與櫃買前 200 大成分股的投資。…

### [昇佳 今納富櫃雙成分股](#)

2020/6/15 工商時報

昇佳電子（6732）上周新掛牌上櫃，創 970 元掛牌新高價及周漲幅 94.79%，幾近翻倍漲。昇佳電子將在今（15）日納入櫃買富櫃 50、以及富櫃 200 兩大指數成分股，將有後續法人布局基本持股買盤，有利於今日股價挑戰成為千金股，也有機會帶動櫃買行情。…

### [ETN 趨勢導航／三檔 ETN 本周漲逾 5%](#)

2020/6/20 經濟日報

台股本周先抑後揚，在資金行情推波助瀾下，沿 5 日線持續盤堅，櫃買指數強勢創波段新高，帶動元大富櫃 200N（020014）、永豐富櫃 200N、永昌富櫃 200N 等三檔指數投資證券（ETN）大漲逾 5%，表現相當吸睛。…

➤ 櫃買中心編製之櫃買富櫃 200 指數相關之所有權利均歸櫃買中心所有，更多詳細資料可於櫃買中心[首頁](#)>[指數系列](#)>[櫃買富櫃 200 指數](#)項下查詢。