

櫃買半導體領航報酬指數編製規則

第一章 前言

半導體公司為櫃買市場的重要族群，隨著 AI、5G 物聯網時代全面到來，上櫃半導體公司在市場上亦占有重要地位，本指數係自富櫃 200 指數成分股中篩選具代表性之半導體公司為成分股，為一兼顧交易性及代表性之指數。

第二章 成分股的選股原則

第一節 採樣範圍

櫃買富櫃 200 指數成分股中屬半導體產業者。

第二節 成分股選擇標準

- 一、最近一個會計年度無累積虧損。
- 二、最近四季每股稅後純益合計數為正數者。
- 三、挑選流通市值前 10 大為指數成分股，並取其後 5 檔股票為候補名單。
- 四、為兼顧指數成分股之分散性，單一成分股權重上限為 20%(不含)。

第三章 指數計算方法

第一節 計算頻率

櫃買半導體領航報酬指數於櫃檯買賣交易時間內，每隔 5 秒以成分股最新成交價格計算及公布即時指數一次，並於每日收市後計算一次收市指數。

第二節 計算公式

指數使用下列公式計算

$$\sum_{i=1}^n \frac{(p_i \times s_i \times f_i \times w_i)}{d} \times 5,000$$

其中

i = 成分股公司別，其中 n=10

p = 成分股最近期成交價格

s = 成分股發行股數

f = 公眾流通量係數

w = 權重調整因子

d = 指數基值

第四章 成分股審核

櫃買半導體領航報酬指數的成分股訂於一月、四月、七月和十月的第一個星期五後的星期四辦理季審核，使用前一年十二月及同年三月、六月、九月最後交易日的收市資料進行審核。任何成分股的變動會第三個星期五後的次一個交易日生效。

第五章 成分股的變更

若櫃買半導體領航報酬指數成分股在兩次季審核間從富櫃 200 指數中刪除，則亦將同時從櫃買半導體領航報酬指數中刪除，其缺額將會由其被刪除前二營業日指數計算結束時，候補名單中流通市值排名最高者遞補。

第六章 成分股維護事宜

除因季審核調整指數成分股及權重外，指數成分股之發行股數及調整公眾流通量等維護事宜，均依本中心「部分集合指數企業活動及企業事件處理原則」辦理。