

TPEX FactSet 氣候韌性指數系列編製規則

第一章 前言

TPEX FactSet 氣候韌性指數系列為本中心與 FactSet 公司共同編製之指數，係以富櫃 200 指數成分股為母體，採用 Entelligent 公司的氣候模型所計算之 T-Risk¹，對成分股進行篩選或調整權重，用以反應富櫃 200 指數成分公司因應氣候變遷之韌性。

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。

第二節 成分股選擇標準

- 一、「TPEX FactSet 氣候韌性指數」：成分股為櫃買富櫃 200 指數成分股。
- 二、「TPEX FactSet 半導體氣候韌性指數」：成分股為櫃買富櫃 200 指數成分股中，挑選 FactSet 的 Revere Business Industry Classification System (RBICS) 產業中屬半導體設備、服務及半導體製造(Level3)之公司，成分股檔數不固定。
- 三、「TPEX FactSet 半導體氣候淨零優選報酬指數」：成分股須符合下列標準：
 - (一) 流動性檢驗：最近 3 個月日平均成交值超過新台幣 1 千萬元。
 - (二) 挑選 FactSet 的 RBICS 產業中屬半導體設備、服務及半導體製造(Level3)之公司。
 - (三) 刪除未有 T-Risk 或 F-Score²之公司。
 - (四) 以 T-Risk 由小至大排序，刪除最後 40%(含)之公司。
 - (五) 刪除 F-Score 未達 5 分之公司。

¹ 氣候轉型風險指標，數值越低代表適應氣候變遷的能力越好。

² F-Score (Piotroski F-Score) 又稱為皮爾托斯基分數，係由 9 個基本面來檢視股票，總分在 0 分到 9 分。

(六) 以發行市值由大至小排序，選取 10 檔成分股。

第三節 權重計算方式

- 一、「TPEX FactSet 氣候韌性指數」及「TPEX FactSet 半導體氣候韌性指數」以 Entelligent 公司之 T-Risk 及各公司自由流通市值，對成分股進行加權計算。
- 二、「TPEX FactSet 半導體氣候淨零優選報酬指數」以各成分股之公眾流通量市值計算。
- 三、為兼顧指數成分股之分散性，各指數單一成分股權重不超過 30%，並限制前五大成分股權重合計須低於 65%。

第三章 指數計算方法

第一節 計算頻率

- 一、「TPEX FactSet 氣候韌性指數」及「TPEX FactSet 半導體氣候韌性指數」自 112 年 9 月 25 日起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。本中心另編製報酬指數，其係考量現金股利因素後加以調整，用以反映包含現金股利之報酬指數，該指數揭示頻率與價格指數相同。
- 二、「TPEX FactSet 半導體氣候淨零優選報酬指數」考量現金股利因素以反映包含現金股利之報酬；自該指數 112 年 9 月 25 日起於櫃買中心交易時間內，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，並於每日收盤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 = 成分股家數
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

- 一、「TPEX FactSet 氣候韌性指數」及「TPEX FactSet 半導體氣候韌性指數」的成分股訂於 2 月和 8 月的第一個星期五後的星期四辦理定期審核，使用同年 1 月及 7 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。
- 二、「TPEX FactSet 半導體氣候淨零優選報酬指數」的成分股訂於 2 月、5 月、8 月和 11 月的第一個星期五後的星期四辦理季審核，使用同年 1 月、4 月、7 月和 10 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 成分股維護事宜

除因定期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。