



特選Smart多因子指數

富蘭克林坦伯頓集團旗下之富蘭克林顧問公司(Franklin Advisors, Inc., FAV)致力於研究多因子量化策略，將多因子模型結合傳統市值加權方法，利用多元財務、市場指標表彰投資因子特性，運用品質、價值以及動能等投資因子與市場權值股指標篩選成分股，以多因子量化模型分配權重，增強投資績效表現；FAV提供指數選股方式及權重配置之專有方法，由臺灣指數公司酌量臺灣市場特性，設計指數編製規則，編製「臺灣指數公司特選Smart多因子指數」(簡稱「特選Smart多因子指數」)。

指數編製方法

採樣母體	臺灣證券交易所上市普通股
篩選條件	指數母體中通過流動性檢驗、選取符合具市值規模以及多因子(品質、價值與動能)條件的上市公司股票。
加權方式	1. 投資因子加權。 2. 單一個股權重上限 = $\min\{\text{市值權重} + 2\%, \text{市值權重} \times 5\}$ 且不得超過30%

指數基本資料

發布日	2020/08/10
基期	2020/08/07
基期指數	5000
定期審核	每年1、4、7、10月
指數計價幣別	新臺幣
指數計算類別	價格/報酬
成分股數目	120(檔數不固定)

指數特色

成分股市值	
總市值	33432.51
平均市值	278.6
最大市值	15947.18
中位數市值	26.08
最小市值	6.42
2021年股息殖利率(%)	3.48

*市值單位：新台幣十億元

指數代碼

Bloomberg	Thomson Reuters
IX0137(PR)	. IX0137(PR)
	. IX0137R(TR)

*資料時間：2021-12-30

聯絡資訊：臺灣指數公司 客戶關係部 電話：886-02-8729-9019 電子郵件：TIPClient@taiwanindex.com.tw

報酬指數績效圖

資料期間：2020年8月 - 2021年12月



報酬指數績效表現(新臺幣)

特選Smart多因子指數	近 1 個月	近 3 個月	近 6 個月	近 1 年	近 3 年	近 5 年
報酬率	4.93%	6.25%	2.87%	31.02%	—	—
年平均報酬率	—	—	—	29.63%	—	—
年化標準差	—	—	—	18.52%	—	—
夏普比率	—	—	—	159.97%	—	—

指數成分股資訊

產業權重分布	比重	成分股檔數	數量	成分股權重	比重
電子產業	67.31%	大型股	27	大型股	78.61%
傳統產業	24.66%	中型股	48	中型股	16.47%
金融產業	8.03%	小型股	45	小型股	4.92%

*傳統產業係臺灣證券交易所與櫃買中心產業分類非屬電子工業、金融保險業之股票

*大型股:原始市值≥1000億元、中型股:1000億元>原始市值>200億元、小型股:原始市值≤200億元

指數權重前十大成分股

股票代號	公司名稱	產業分類	股票代號	公司名稱	產業分類
2330	台積電	半導體類	2412	中華電	通信網路類
2454	聯發科	半導體類	2303	聯電	半導體類
2317	鴻海	其他電子類	2882	國泰金	金融保險類
2881	富邦金	金融保險類	6505	台塑化	油電燃氣類
2603	長榮	航運類	2308	台達電	電子零組件類

免責聲明

所有於本文件所載之資料僅供參考之用。臺灣指數公司全力確保上述資料之準確及可靠，但臺灣指數公司並不作出任何聲明或保證就該等資料的準確性、正確性、完整性或可依賴性。臺灣指數公司不提供任何明示或默示之聲明或保證，且臺灣指數公司就任何人因直接或間接依賴信賴本文件之任何內容作成投資決定，或因此本文件所載含之任何資料之有錯誤或遺漏所衍生造成之任何損害或損失，臺灣指數公司概不負任何法律責任。臺灣指數公司保有此文件內容不時作出有權隨時更新任何資料而毋須另行通知之權利。任何人本文件所載之資料，不應成為任何人作出投資決定的依據，臺灣指數公司特此聲明。 臺灣指數股份有限公司版權所有©2019