

台股基金五虎將指數

TSF-Top5 Index

2026 H1 建倉與維護規格書 (Official Specification V1.0)

發布日期：2026年1月24日

鎖定最強攻擊手 · 追求極致超額報酬

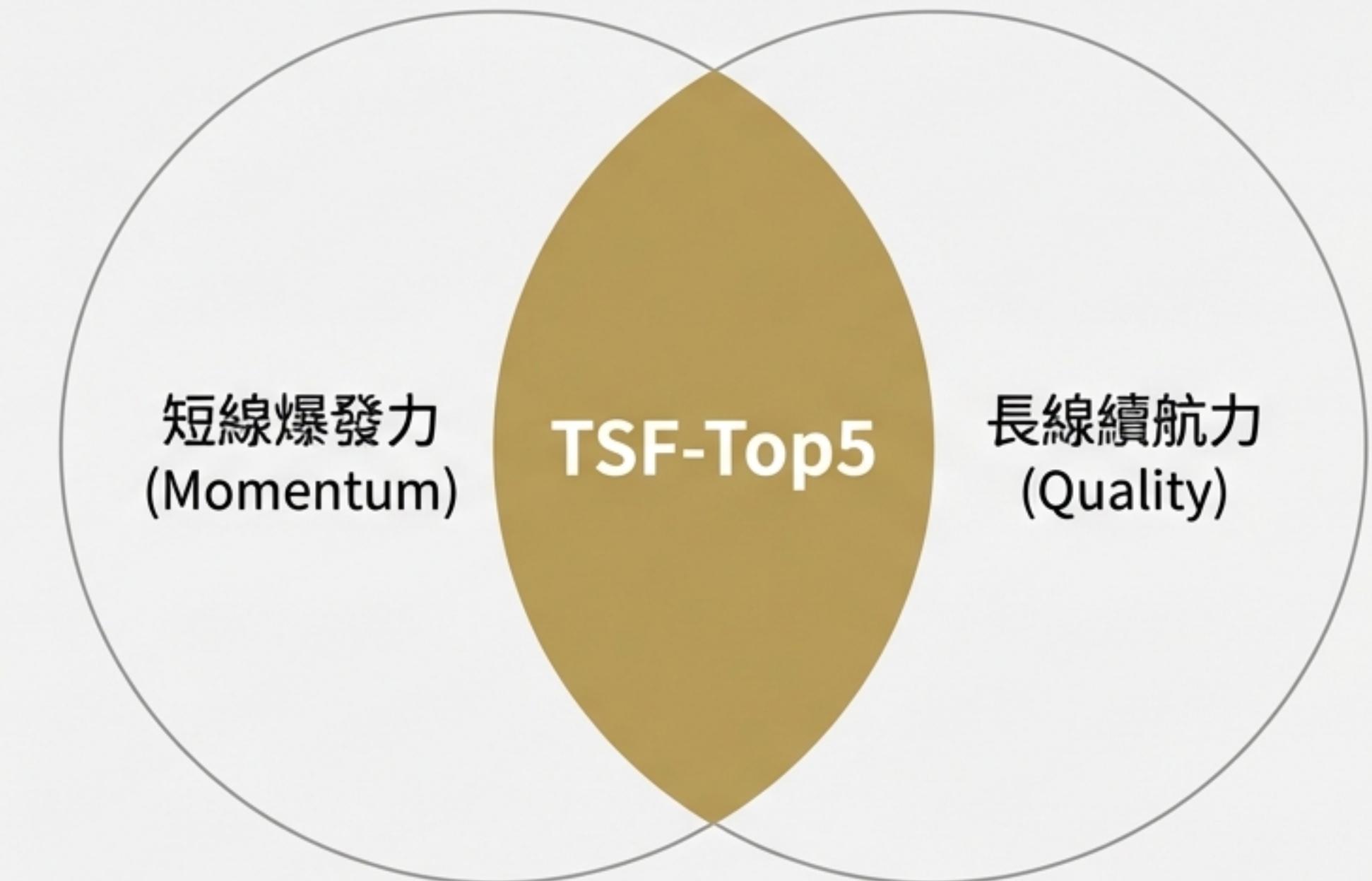
基於真實市場數據校正版

指數核心目標

Index Objective

追蹤台股主動式基金中，「短線爆發力」與「長線續航力」綜合表現最強之五檔基金。

- Alpha Generation：透過量化評分與緩衝機制，過濾市場雜訊。
- Target：追求超越大盤 (TWSE) 與 0050 ETF 之超額報酬。
- Philosophy：鎖定不同時期的「最強攻擊手」(The Best Strikers)。



532 評分模型

The Scoring Engine

$$Score = (R1y \times 50\%) + (R3y \times 30\%) + (R5y \times 20\%)$$

(Note: R1y denotes 1-Year Return, etc.)

50% Momentum
(即時戰力)

30% Medium
(三年績效)

20% Long
(五年績效)

設計邏輯

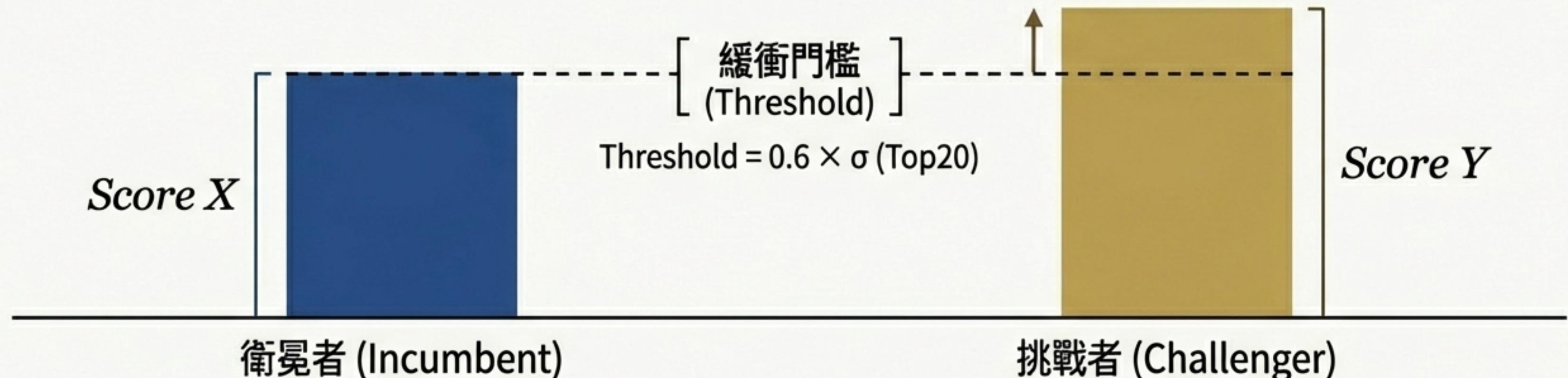
- 50% Momentum : 重視即時戰力 (1-Year Return) 以捕捉市場主流。
- 50% Quality : 確保長期實力 (3-Year + 5-Year Return) 以提供防禦支撐。

選股母體：投信發行之國內投資股票型基金
(排除成立未滿 5 年、ETF、外幣計價)。

調整與緩衝機制

Rebalancing & Buffer Protocol

成分股數	權重分配	審核週期
固定 5 檔	等權重 (20%)	每半年 (6/30, 12/31)



設計目的：避免因數據微小雜訊而頻繁換股，降低交易成本。

2026 H1 成分股入選名單

The Roster

排名 (Rank)	基金名稱 (Fund Name)	綜合評分 (Tiger Score)	狀態 (Status)
1	統一奔騰基金	180.60	INCLUDED
2	安聯台灣科技基金	179.47	INCLUDED
3	路博邁台灣5G股票基金	178.76	INCLUDED
4	野村鴻運基金	177.75	INCLUDED
5	野村台灣運籌基金	168.57	INCLUDED
6	富邦新台商	165.97	EXCLUDED
7	野村高科技基金	163.60	EXCLUDED

戰術角色定位

Team Composition



👑 王者
(Leader)

統一奔騰

綜合分數全市場
第一，核心攻擊
手。



⚓ 權值
(Anchor)

安聯台灣科技

規模最大且績效
極穩，提供指數
穩定性。



🚀 新星
(Rising Star)

路博邁台灣5G

數據黑馬。近期
爆發力極強，超
越野村軍團。



⚔ 戰將
(Warrior)

野村鴻運

野村系列目前的
領頭羊。



🛡 守門
(Gatekeeper)

野村台灣運籌

守住第五名位置
，險勝富邦新台
商。

數據透視與選股邏輯

Data Insights



The Gatekeeper's Margin

險勝關鍵：第 5 名（野村台灣運籌）與第 6 名（富邦新台商）的分數差距僅 僅 2.6 分。這顯示了 Top 5 競爭的激烈程度。



The Fall of a Giant



名將落馬：野村高科技（Nomura High Tech）為市場熱門基金，但在本模型中僅排第 7 名 (163.6分)。

Insight: 模型依靠硬數據而非名氣，該基金近期動能未達前五標準。



The Dark Horse



黑馬竄出：路博邁台灣5G衝進前三名，驗證了模型中「50% 動能因子」能有效捕捉市場新興強勢股。

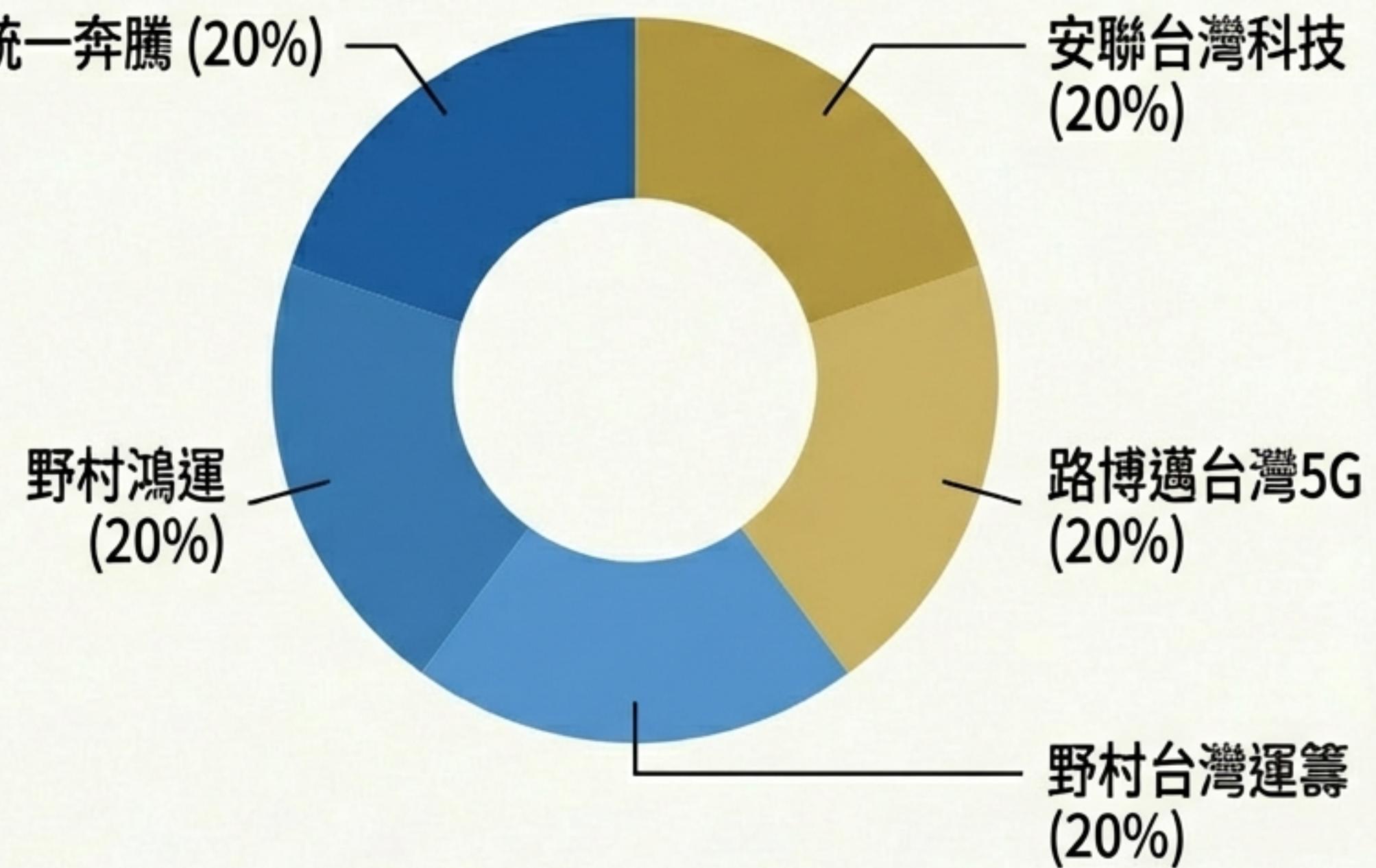
執行指南：建立部位

Execution: Initialization

立即執行 (Immediate Action)

2026年1月

請依照 20% 等權重配置以下五檔基金。



未來監控參數

Monitoring Parameters for 2026/06/30

Control Panel

前段班平均分數 (Top 20 Avg)

158.0

標準差 (Top 20 Std Dev)

14.28

換股緩衝值 (Buffer Threshold)

8.57

0.6×14.28

換股規則 (Rebalancing Rule):

若 [挑戰者分數] > [衛冕者分數] + 8.57，則執行換股。

總結與行事曆

Summary & Calendar



TSF-Top5 Index Specification V1.0

Designed for Professional Implementation

Disclaimer: Past performance is not indicative of future results.