

公告日期：中華民國 108 年 4 月 11 日

公告文號：第一金投信(108)字第 228 號

主旨：「第一金臺灣工業菁英 30 ETF 傘型證券投資信託基金」(以下簡稱本基金)修正基金公開說明書，業經 108 年 4 月 11 日經金融監督管理委員會核准。

說明：

- 一、依據金融監督管理委員會 108 年 4 月 11 日金管證投字第 1080308997 號函辦理。
- 二、因指數公司修改本基金之第一金臺灣工業菁英 30 ETF 證券投資信託基金追蹤標的指數「工業菁英 30 指數」之指數編制規則，故配合修改基金公開說明書之指數編製方式，修正對照表詳列如下表。
- 三、修正後基金公開說明書可於公開資訊觀測站(<http://mops.twse.com.tw>)及本公司網站(<http://www.fsitc.com.tw>)下載。

第一金臺灣工業菁英 30 ETF 傘型證券投資信託基金公開說明書修正對照表

項次	修正後	修正前	修正說明
肆、 九、 (一)、 第 20 頁	<p>指數編製方式</p> <p>工業類股占臺灣上市公司總家數超過 7 成，為臺灣經濟發展主力，深具國際競爭力！臺灣指數公司利用優勢投資因子篩選投資組合，兼顧股票市值以及公司獲利好且有持續性、財務體質穩健、股利穩定等適合長期投資的特質，編製「臺灣指數公司工業菁英 30 指數」（簡稱「工業菁英 30 指數」）。</p> <p>1.成分股的選股原則： ➢ 採樣母體 臺灣指數公司工業菁英 30 指數以臺灣證券交易所所有上市的普通股中，依臺灣證券交易所產業分類，將選擇水泥類、食品類、塑膠類、紡織纖維類、電機機械類、電器電纜類、化學類、生技醫療類、玻</p>	<p>指數編製方式</p> <p>臺灣指數公司工業菁英 30 指數係由臺灣指數股份有限公司編製而成，綜合參考以公司規模、營運穩定性、獲利能力及股利發放等為篩選條件，挑選前 30 家代表性公司為指數成分股。該指數以 105 年 12 月 16 日為基期，並於 105 年 12 月 19 日正式對外發布，工業菁英 30 指數基期指數設定為 5,000 點；另外，工業菁英 30 指數日報酬反向一倍指數，於 106 年 9 月 8 日正式對外發布，基期指數設定為 10,000 點。</p> <p>1.成分股篩選方式： 臺灣指數公司工業菁英 30 指數以臺灣證券交易所所有上市的普通股中，依臺灣證券交易所產業分類，將選擇水泥類、食品類、塑膠類、紡織纖維類、電機機械類、電器電纜類、化學類、生技</p>	<p>因台灣指數公司修改第一金臺灣工業菁英 30 ETF 基金追蹤標的指數「工業菁英 30 指數」之指數編制規則，故參照該規則修改後文字，修正基金公開說明書之指數編製內容。</p>

項次	修正後	修正前	修正說明
	<p>璃陶瓷類、造紙類、鋼鐵類、橡膠類、汽車類(屬製造業公司)、半導體類、電腦及週邊設備類、光電類、通信網路類(不含電信公司)、電子零組件類、其他電子類、建材營造類、航運類(屬製造業公司)、其他類(屬製造業公司)之股份，但排除經依「臺灣證券交易所股份有限公司營業細則」第 49 條列為變更交易方法或依第 50 條停止買賣的股票。</p> <p>➤ <u>成分股篩選標準</u></p> <p>(1)<u>流動性檢驗</u></p> <p>A. <u>最近 12 個月成交金額總額由大到小排序，前 20%無條件通過流動性檢驗，另刪除最後 20%的股票。</u></p> <p>B. <u>滿足以下任一條件即可：</u></p> <p>a <u>近三個月月平均成交量達 10000 交易單位。</u></p> <p>b <u>近三個月月平均週轉率達 6%，週轉率=成交量/發行股數。</u></p> <p>(2)<u>成分股篩選方法</u></p> <p>A. <u>選取符合財務指標與股利發放指標的上市公司股票。</u></p> <p>B. <u>再依股票市值由大到小排序，選取前 30 名股票。</u></p> <p>(3)<u>權重計算</u></p> <p>A.<u>自由流通市值加權；成分股自由流通量係數於每次成分股定期審核生效日，依據臺灣指數公司「自由流通量係數</u></p>	<p>醫療類、玻璃陶瓷類、造紙類、鋼鐵類、橡膠類、汽車類(屬製造業公司)、半導體類、電腦及週邊設備類、光電類、通信網路類(不含電信公司)、電子零組件類、其他電子類、建材營造類、航運類(屬製造業公司)、其他類(屬製造業公司)之股份，但排除經依「臺灣證券交易所股份有限公司營業細則」第 49 條列為變更交易方法或依第 50 條停止買賣的股票。</p> <p>(1)<u>流動性檢驗</u></p> <p>A.<u>刪除在最近 1 年日平均交易金額排序最小 20%的股票，日平均交易金額以市場有交易之日數計算。</u></p> <p>B.<u>刪除最近 3 個月平均成交量低於 10,000 交易單位之股票。</u></p> <p>(2)<u>選取符合財務指標與股利發放指標的上市公司股票。</u></p> <p>A.<u>稅後淨利連續三年大於 0。</u></p> <p>B.<u>稅後淨利/營收連續三年排名前 50%。</u></p> <p>C.<u>連續三年每股現金股利發放排名前 50%。</u></p> <p>(3)<u>成分股權重限制</u></p> <p>A.<u>個別成分股的權重上限為 20%。</u></p> <p>B.<u>前 5 大權值股合計不超過 60%。</u></p>	

項次	修正後	修正前	修正說明
	<p><u>編製規則</u>」產製之最近期數據更新。</p> <p><u>B.前依自由流通市值作為計算標準，個別成分股權重不得超過20%，且前五大成分股權重總和不得超過60%。</u></p> <p>2. 指數計算：</p> <p>(1)工業菁英 30 指數：</p> <p>A. 於股市交易時間內發布即時計算之「<u>價格指數</u>」(Price Index)(<u>不包含現金股利調整</u>)：</p> <p>指數 = (權重調整係數調整後指數總市值/指數除數) × 基準指數</p> $Index_{(t)} = \frac{\sum_{i=1}^n c_i \times f_i \times s_{i(t)} \times p_{i(t)}}{Divisor_{(t)}} \times 500$ <p>n = 指數成分股數目</p> $p_{i(t)}$ <p>= i 成分股在 t 日的最新成交價格</p> $s_{i(t)}$ <p>= i 成分股在 t 日的發行股數</p> c_i <p>= 權重調整係數，以審核資料日規定之成分股權重上限設算。</p> $c_i \times f_i \times s_{i(t)} \times p_{i(t)}$ <p>= i 成分股在 t 日的「指數成分股市值</p> <p>Divisor = 指數除數；收盤後成分股依臺灣指數公司「<u>TIP 指數系列企業活動處理通則</u>」<u>市值投資型指數調整指數除數以維持指數連續性，調整方式如下：</u></p> <p>指數除數</p> <p>= 前 1 日指數除數</p> $\times \left(\frac{\text{前 1 日收盤之指數成分股市值總和} \pm \text{異動指數市值}}{\text{前 1 日收盤之指數成分股市值總和}} \right)$	<p>2. 指數計算方式：</p> <p><u>指數計算發布頻率比照「臺灣證券交易所發行量加權股價指數」辦理，即於股市交易時間內，每 5 秒計算 1 次。</u></p> <p>(1)工業菁英 30 指數：</p> <p>指數 = (權重調整係數調整後指數總市值/當日基值) × 基期指數</p> $Index_{(t)} = \frac{\sum_{i=1}^n c_i \times s_{i(t)} \times p_{i(t)}}{Divisor_{(t)}} \times 500$ <p>n = 指數成分股數目</p> $p_{i(t)}$ <p>= 在 t 日的股價</p> $s_{i(t)}$ <p>= 在 t 日的發行股數</p> c_i <p>= 權重調整係數，以審核基準日規定之成分股權重上限設算。</p> <p>Divisor = 基值</p> $c_{i(t)} \times s_{i(t)} \times p_{i(t)}$ <p>= i 成分股在 t 日的「指數成分股市值</p> <p>(2)工業菁英 30 日報酬反向一倍指數：</p> <p>指數 = 前一日工業菁英 30 日報酬反向一倍指數 × {1+R×(當盤工業菁英 30 指數點數/前一日工業菁英 30 指數收盤點數-1)}；反向倍數 R = -1</p>	

項次	修正後	修正前	修正說明
	<p><u>註 1：基期設定為 2016 年 12 月 16 日，基準指數設定為 5000 點。</u></p> <p><u>註 2：在基期之指數除數即為當時指數成分股市值總和</u></p> $\sum_{i=1}^n c_i \times f_i \times S_{i(\text{launch})} \times p_{i(\text{launch})}, \text{ launch} = \text{基期。}$ <p>B. 本於每 1 交易日收盤後，發布 1 次「報酬指數」(Total Return Index)(包含現金股利調整)</p> <p>指數 = $\frac{\text{指數成分股市值總和}}{\text{當日報酬指數之指數除數} \times \text{基準指數}}$</p> $Index_{(t)} = \frac{\sum_{i=1}^n c_i \times f_i \times S_{i(t)} \times p_{i(t)}}{DivisorTR_{(t)} \times 5000}$ <p><i>DivisorTR</i> = 「報酬指數」之指數除數</p> <p>成分股除息時，指數除數調整公式：</p> <p>指數除數 = 前 1 日指數除數 × $\left(\frac{\text{前 1 日收盤之指數成分股市值總和} \pm \text{異動指數市值總和}}{\text{前 1 日收盤之指數成分股市值總和}} \right)$</p> <p>(2)工業菁英 30 日報酬反向一倍指數：</p> <p>指數 = 前一日工業菁英 30 日報酬反向一倍指數 × {1+R×(當日工業菁英 30 指數點數/前一日工業菁英 30 指數收盤點數-1)}；反向倍數 R = -1</p> <p><u>註 1：基期設定為 2017 年 9 月 8 日，基準指數設定為 10000 點。</u></p> <p>3. 計算發布頻率</p> <p>A. 「價格指數」於臺灣證券交易所交易時間內，每隔五秒以成分股最新成交價格計算及公布</p>	<p>3.指數成分股調整及指數維護作業</p> <p>(1)定期審核</p> <p><u>每年進行一次成分股審核，以 4 月的第 10 個營業日為審核基準日。每年度定期審核後，維持固定的成分股數目為 30 支。排名在前 24 名以內之股票即納入成為指數成分股，現有成分股若排名在第 36 名之</u></p>	

項次	修正後	修正前	修正說明
	<p><u>即時指數一次。</u></p> <p>B. <u>「報酬指數」於每 1 交易日收盤後，計算發布 1 次。</u></p> <p>4. 指數成分股調整及指數維護作業</p> <p>(1)定期審核</p> <p>A. <u>每年 1 次進行成分股審核，以 4 月的第 17 個交易日為審核日，審核資料截至 4 月的第 10 個交易日。每次年度定期審核後，維持固定的成分股數目為 30 檔。</u></p> <p>B. <u>成分股調整之緩衝區：排名在第 24 名以內之股票即納入成為指數成分股，現有成分股若排名在第 36 名之後則從指數成分股中刪除。</u></p> <p>C. <u>成分股定期審核結果，於 4 月的第 17 個交易日收盤後發布技術通知後，間隔 5 個交易日收盤後生效。</u></p> <p>D. <u>指數除數維護方式，採成分股定期審核生效日前一交易日收盤資料，計算新成分股組合與原成分股組合之指數市值（權重調整係數及自由流通量係數調整後指數總市值）差異作為異動指數市值總和。</u></p> <p>E. <u>金融控股公司或投資控股公司定期審核使用之成分股篩選資料期間不足者，如轉換股份之代表公司符合採樣母體資格，得合併採用該代表公司或股票之資料。</u></p> <p>(2)<u>不定期調整、權重調整係數、發行股數、指數除數等維護，依臺灣指數公司「TIP 指數系列企業活動處理通則」辦理。</u></p> <p>(3) <u>自然流通量係數處理原則：</u></p> <p>A. <u>自由流通量係數若低於 10%，則不納入成分股採樣。</u></p> <p>B. <u>配合定期審核成分股</u></p>	<p><u>後則從指數成分股中刪除。審核結果於 4 月的第 17 個營業日發布技術通知，5 個營業日後生效。</u></p> <p>(2)不定期調整</p> <p>A. <u>成分股若因變更交易方法、停止買賣、終止上市而刪除，將不予遞補，故在定期審核以外期間的成分股數目可能不足 30 支。但成分股若因減資彌補虧損換發股票、現金減資換發股票、被其他公司合併、轉換為控股公司、分割等原因換發新股票而停止買賣，則不予刪除。在停止買賣期間，以停止買賣前 1 營業日收盤價、原發行股數和原權重調整係數保留在指數中持續計算。</u></p> <p>B. <u>兩家以上成分股公司合併，合併後的存續公司若符合採樣母體資格，則保留其成分股資格，並以原成分股的「指數成分股市值」（權重調整係數×發行股數×股價）或原多支成分股合併的「指數成分股市值」</u></p>	

項次	修正後	修正前	修正說明
	<p>生效日，更新所有成分股自由流通量係數。</p> <p>C. <u>成分股自由流通量係數</u>依據臺灣指數公司「<u>自由流通量係數編製規則</u>」產製之最近期數據更新。</p>	<p><u>回推新成分股的權重調整係數。若有成分股因被合併而刪除，所產生的空缺將在下一次定期審核時補齊。</u></p> <p>C. <u>成分股公司單獨以股份轉換方式轉換為金融控股公司或投資控股公司、或與其他公司共同以股份轉換方式成立新設金融控股公司或投資控股公司，轉換後或新設的金融控股公司或投資控股公司若符合採樣母體資格，則取代成為新成分股，並以原成分股的「指數成分股市值」回推新成分股的權重調整係數。若有成分股因股份轉換而刪除，所產生的空缺將在下一次定期審核時補齊。</u></p> <p>D. <u>成分股公司被非成分股公司以股份或股份加現金方式合併，合併後的存續公司或新設公司若符合採樣母體資格，則以該公司取代被合併的成分股公司成為新成分股，並以原成分股的「指數成分股市值」之淨額回推新成分股的權重調整係數。</u></p> <p>E. <u>若成分股公司被不符合採樣母體資格的公司收購或合併而終止上市，則將該成分股從指數中刪除，並調整基值，所產生的空缺將在下一次定期審核時補齊。</u></p>	

項次	修正後	修正前	修正說明
		<p><u>F.若一家成分股公司分割成兩家以上公司，分割公司或分割受讓公司若符合採樣母體資格，則保留或納入成為新成分股，並以原成分股的「指數成分股市值」回推該等成分股的權重調整係數。因成分股之分割，可能會導致在定期審核以外期間的成分股數目超過 30 支。</u></p>	