

00858

永豐美國大型500股票ETF基金 指數編製規則

標的指數：STOXX 美國500股票指數
(STOXX® USA 500 INDEX)

指數編製方式：

STOXX® USA 500 INDEX 之指數計算方式採自由流通市值加權方法計算，計算時間為 15:30-22:00 CET (歐洲中部時間)。

STOXX® USA 500 INDEX 之樣本空間是以母指數 STOXX® USA 900 指數為基礎，其挑選在美國交易所上市，自由流通市值最高的前 900 家企業作為該指數成分股。指數計算方式採自由流通市值加權方法計算，計算時間為 15:30-22:00 CET (歐洲中部時間)；指數中所有成分股的股價都需折合成歐元和美元 (永豐美國大型 500 股票 ETF 基金標的為美元指數)，規則如下：

- 歐元指數：所有非歐元股價一律折合成歐元，然後納入指數計算。
- 美元指數：所有非歐元股價一律折合成歐元 (同上)，然後連同所有歐元股價一併折合成美元，進行指數計算。

成分股篩選標準：

STOXX® USA 500 INDEX 之母指數為 STOXX® USA 900 指數，在此 STOXX® USA 900 基礎下，選出自由流通市值前 500 檔股票名單。

成分股檢視與審核機制：

指數審核頻率為每季度之 3、6、9、12 月，審核時間結算日為 3、6、9、12 月前一個月的最後交易日，也就是 2、5、8、11 月的最後交易日。

基準資料宣告日 (Underlying Data Announcement)：(包含總股數/自由流通股數/權重與上限因子等) 會在執行日前 5 個交易日前公布。

執行日 (Review Implementation date)：執行日基準為每年的指數審核月份 3、6、9、12 月的第 3 個禮拜五。

生效日 (Review Effective)：生效日為執行日的隔一個交易日。