

00886

永豐美國科技ETF基金 指數編製規則

標的指數：美國科技股票指數
(NYSE FactSet® U.S. Tech Breakthrough Index)

指數編製方式：

NYSE FactSet® U.S. Tech Breakthrough Index 指數樣本是以在美國紐約證交所 (NYSE) 及那斯達克證交所 (NASDAQ)、芝加哥選擇權交易所下轄美國股票交易所 (CBOE U.S. Equities Exchanges)、美國投資者交易所 (Investor Exchange) 上市股票，符合機器人與人工智慧 (Robotics and Artificial Intelligence)、網路安全 (Cyber Security)、雲端資訊技術 (Cloud and Data Tech)、金融科技 (Financial Technology)、基因與免疫學 (Genomics and Immunology) 五大主體領域，以自由流通市值由高至低排序作為該指數成分股。

成分股篩選標準：

(1) 公司需符合機器人與人工智慧、網路安全、雲端資訊技術、金融科技、基因與免疫學五大主體領域，各領域選取標準及產業內涵如下：

A. 機器人與人工智慧：成分股自由流通市值需在 5 億美元以上、3 個月日平均成交均值需在 200 萬美元以上。B. 網路安全：成分股自由流通市值需在 3 億美元以上、3 個月日平均成交均值需在 200 萬美元以上。

C. 雲端資訊技術：成分股自由流通市值需在 3 億美元以上、3 個月日平均成交均值需在 200 萬美元以上。

D. 金融科技：成分股自由流通市值需在 3 億美元以上、3 個月日平均成交均值需在 200 萬美元以上。

E. 基因與免疫學：成分股自由流通市值需在 3 億美元以上、3 個月日平均成交均值需在 200 萬美元以上。

(2) 符合上述五大主體領域選取標準的公司進一步以其主要交易所與成立國家篩選，只納入在美國成立且在美國紐約證交所 (NYSE) 及那斯達克證交所 (NASDAQ)、芝加哥選擇權交易所下轄美國股票交易所 (CBOE U.S. Equities Exchanges)、美國投資者交易所 (Investor Exchange) 掛牌之公司，同時必須符合自由流通市值需在 5 億美元以上、3 個月日平均成交均值需在 200 萬美元以上的條件。

(3) 若有公司同時符合五大主體領域中兩個以上領域的選取標準，則以其所占權重較低之領域為準。

成分股檢視與審核機制與再平衡：

指數於每年 6、12 月的第一個星期五定義為參考日 (Reference Date)，每年 12 月的第三個星期五依據參考日的資料進行成分股檢視與審核 (Index Reconstitutions)，並於每年 6、12 月的第三個星期五依據參考日的資料進行成分股再平衡調整 (Index Rebalance)。

再平衡調整時除依上述權重計算方式重新計算權重外，成分股另依前述之選取標準檢視市值與流動性狀況，故可能有成分股剔除。再平衡調整的結果於調整日的下一個交易日生效。

成分股之檢視審核機制時重新執行前述之選取標準重新，成分股僅可透過檢視審核機制新增納入，並無另設備選名單或快速納入機制，亦無另設緩衝區機制。

成分股之檢視審核機制與再平衡調整會在調整月份的第二個星期五前的星期一交易時間截止後公布。