

臺灣證券交易所發行量加權股價指數系列指數編製要點

一、前言

臺灣證券交易所發行量加權股價指數系列指數（下稱「加權指數系列指數」）係衡量臺灣上市市場各產業類股整體績效表現的指數。

二、計算與管理

- （一）加權指數系列指數分「價格指數」(Price Index)、「報酬指數」(Total Return Index)，詳如附表一及附表二，由臺灣證券交易所（下稱本公司）負責編製、計算及即時資訊傳輸。
- （二）本公司委請臺灣指數公司依本指數編製要點進行指數維護。
- （三）本公司保存成分股的收盤市值紀錄。

三、成分股選股原則

加權指數系列指數皆為全集合指數，以「臺灣證券交易所發行量加權股價指數」成分股為採樣母體，依「臺灣證券交易所股份有限公司上市公司產業類別劃分暨調整要點」定義上市公司所屬之產業類別，各指數成分股說明如下：

- （一）未含金融保險股發行量加權股價指數：發行量加權股價指數之成分股扣除產業類別劃分為金融保險類者。
- （二）未含電子股發行量加權股價指數：發行量加權股價指數之成分股扣除電子類指數成分股者。
- （三）未含金融電子股發行量加權股價指數：發行量加權股價指數之成分股扣除產業類別劃分為金融保險類及電子類指數成分股者。
- （四）產業分類股價指數：以各產業類別內之公司為成分股，編製指數。
- （五）涵蓋 2 種以上產業類別股票之股價指數

1. 水泥窯製類：涵蓋產業類別劃分為水泥工業類和玻璃陶瓷類之上市公司。
2. 塑膠化工類：涵蓋產業類別劃分為塑膠工業類、橡膠工業類、化學工業類和生技醫療類之上市公司。
3. 機電類：涵蓋產業類別劃分為電機機械類、電器電纜類之上市公司及電子類指數成分股。
4. 電子類：涵蓋產業類別劃分為電子工業類，含半導體類、電腦及週邊設備類、光電類、通信網路類、電子零組件類、電子通路類、資訊服務類及其他電子類之上市公司。
5. 化學生技醫療類：涵蓋產業類別劃分為化學工業類和生技醫療類之上市公司。

四、指數計算方法

(一) 指數計算頻率：

1. 「價格指數」於本公司有價證券集中交易市場交易時間內，每隔五秒以成分股最新成交價格計算及公布即時指數一次，並於每日收盤後計算一次收盤指數。
2. 「報酬指數」考量現金股利因素後加以調整，用以反映包含現金股利之報酬，該指數於本公司有價證券集中交易市場交易時間內，每隔五秒以成分股最新成交價格計算及公布即時指數一次，並於每日收盤後計算一次收盤指數。

(二) 計算公式：

$$\text{系列指數} = (\text{總發行市值} \div \text{當日基值}) \times \text{基期指數}$$

- ##### (三) 加權指數系列指數之維護、計算作業（包含但不限於成分股增刪、計算公式、基值調整原則、基值調整公式及其報酬指數基值之調整公式）皆依據「臺灣證券交易所發行量加權股價指數編製要點」辦理。

系列指數	基期	基期指數
未含金融保險股指數	1966年平均數	100
未含電子股指數	1999年12月28日	8448.84
未含金融電子股指數	2003年12月31日	5890.69
食品類、紡織纖維類、造紙類、建材營造類、金融保險類、水泥窯製類、塑膠化工類、機電類等8檔指數	1986年12月29日	100
電子類、水泥類、塑膠類、電機機械類、電器電纜類、化學生技醫療類、玻璃陶瓷類、鋼鐵類、橡膠類、汽車類、航運類、觀光餐旅類、貿易百貨類、其他類等14檔指數	1994年12月31日	100
半導體類、電腦及週邊設備類、光電類、通信網路類、電子零組件類、電子通路類、資訊服務類、其他電子類、化學類、生技醫療類、油電燃氣類等11檔指數	2007年6月29日	100
綠能環保類、數位雲端類、運動休閒類、居家生活類等4檔指數	2023年6月30日	100

編製價格指數、報酬指數	編製價格指數
<p>未含金融電子股、食品類、紡織纖維類、造紙類、建材營造類、金融保險類、電子類、水泥類、塑膠類、電機機械類、電器電纜類、化學生技醫療類、玻璃陶瓷類、鋼鐵類、橡膠類、汽車類、航運類、觀光餐旅類、貿易百貨類、其他類、半導體類、電腦及週邊設備類、光電類、通信網路類、電子零組件類、電子通路類、資訊服務類、其他電子類、化學類、生技醫療類、油電燃氣類、綠能環保類、數位雲端類、運動休閒類、居家生活類等 35 檔指數。</p>	<p>未含金融保險股、未含電子股、水泥窯製類、塑膠化工類、機電類等 5 檔指數。</p>