

FI S&P500成長指數編製規則

從美國市值前500大企業中挑選出營收/獲利/股價成長性最佳的前段班

STEP 1

S&P 500指數中所有成分股，依據以下因子計算每檔股票的成長因子分數及價值因子分數

成長因子

過去三年營收成長
過去三年EPS成長
過去一年股價上漲

價值因子

每股帳面價值
EPS/股價
營收/股價

成長因子總分

價值因子總分

成長因子排名

價值因子排名

STEP 2

將每檔股票(成長因子排名)除以價值因子排名依次排序

S&P 500指數成分股

S&P500市值
1/3

成長型
96檔

全部納入占
64%

S&P500市值
1/3

成長價值兼具
132檔

依據成長因子
總分相對高低
調整市值權重
占36%

S&P500市值
1/3

價值型
275檔

S&P500
成長指數