

# FT臺灣Smart ETF

## 00905 智慧新存股

漲時重勢，跌時重質

智慧選股，聰明領息



動能因子  
趨勢跟隨輔助



價值因子  
收益緩衝機制



品質因子  
財務體質監控

**3/29**  
強勢募集

Smart多因子  
讓存股更聰明

搜尋 **00905**

現在就上：[www.FTFT.com.tw](http://www.FTFT.com.tw)

富蘭克林 華美 投信

申購請洽

永豐金證券、元大證券、兆豐證券、凱基證券、群益金鼎證券、元富證券、統一綜合證券、華南永昌證券、富蘭克林華美投信



## 選擇台股的三大理由

# 台灣的全球第一，供應鏈地位難撼動



### 世界最強半導體產業

領先全球的先進製程技術／良率高達九成以上／客戶技術保密度高



### 工業之母電路板產業

Republic Of Computer／全球最大製造廠-MIT／智慧應用帶動伺服器成長



### 世界第一電腦王國

技術領先產值全球第一／聚落完整全球獨一無二／創造無數PCB第一紀錄

資料來源：富蘭克林華美投信整理。以上提及之個股僅為舉例用，非為個股之推介，亦非本基金當然持股。

## FT臺灣Smart ETF-量化多因子篩選機制

# 自動智能導航，台股投資最在行

### 品質因子

#### 財務體質監控

#### 高品質、重結構

- 財務結構良好(低槓桿、高毛利)
- 資產運用效率佳(股東權益報酬率)

### 價值因子

#### 收益緩衝機制

#### 股息、股價成長機會

- 尋找低估機會(低本益比)
- 收息增益秘方(高殖利率)



### 動能因子

#### 趨勢跟隨輔助

#### 抓緊趨勢、挖掘機會

- 股價趨勢看俏(股價動能)
- 聚焦成長機會(盈利動能)

### 風險偵測

#### 前方波動預示

#### 風險控管、降低波動

- 標的定期汰換機制
- 確保股票流動性

資料來源：富蘭克林華美投信整理。

## 多因子篩選機制替您把關

# 漲時重『勢』，跌時重『質』

特選SMART多因子指數(含回測資料)與加權指數走勢

(標準化：2006/12/29=100)



資料來源：臺灣指數公司，2006/12/29-2021/12/30；富蘭克林華美投信整理。上述均以總報酬指數為參考。特選SMART多因子指數發布日期為2020/8/10，發行日前之資料為假設回測測試結果，非實際表現，並基於指數發行日當時採用之指數編製方式回溯。<以上資料包含指數回測結果，不代表基金投資組合或指數之實際報酬率及未來績效保證，實際表現可能與回測結果有所差異。基金不同於指數，基金可能有中途清算或合併等情形，投資人無法直接投資指數。>



# 多空淬鍊，優勢看得見

## 特選SMART多因子指數 (含回測資料)



過去13年中9次勝出

### 台灣加權指數

平均年報酬 **17.0%**

過去13年中9次勝出

### 台灣50指數

平均年報酬 **17.3%**

過去13年中8次勝出

### 台灣高股息指數

平均年報酬 **14.9%**

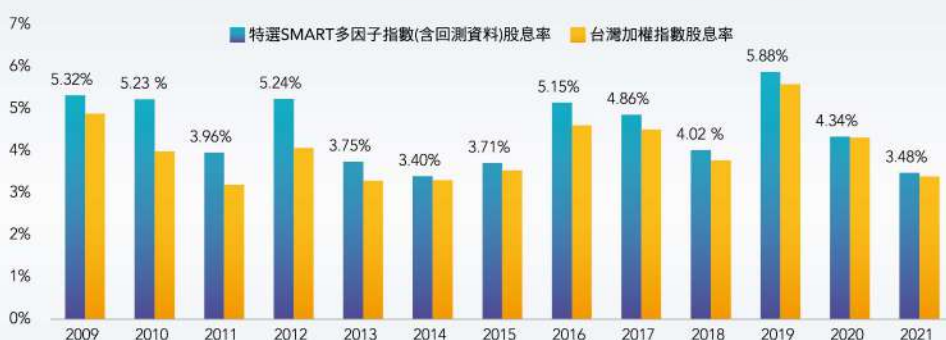
資料來源：臺灣指數公司、Bloomberg，2009/1/5-2021/12/30。富蘭克林華美投信整理。上述四總報酬指數最晚者始於2009/1/5。特選SMART多因子指數發布日期為2020/8/10，發行日前之資料為假設回測測試結果，非實際表現，並基於指數發行日當時採用之指數編製方式回溯。<以上資料包含指數回測結果，不代表基金投資組合或指數之實際報酬率及未來績效保證，實際表現可能與回測結果有所差異。基金不同於指數，基金可能有中途清算或合併等情形，投資人無法直接投資指數。>

# 追求收益，股息再進化

自2009年以來，每年特選SMART多因子指數股息率均高於台灣加權指數股息率。



## 特選SMART多因子指數(含回測資料)股息率(註)更上一層樓



資料來源：臺灣指數公司、Bloomberg，富蘭克林華美投信整理。資料日期：2009/1/5-2021/12/30，特選SMART多因子指數發布日期為2020/8/10，發行日前之資料為假設回測測試結果，非實際表現，並基於指數發行日當時採用之指數編製方式回溯。註：股息率計算方式為總報酬指數減股價指數，台灣加權指數股息率可能與台灣指數公司網站揭露之股息率不同；股息率不代表報酬率，且過去股息率不代表未來股息率。<以上資料包含指數回測結果，不代表基金投資組合或指數之實際報酬率及未來績效保證，實際表現可能與回測結果有所差異。基金不同於指數，基金可能有中途清算或合併等情形，投資人無法直接投資指數。>

# 台股智慧存股新策略

透過特選SMART多因子模型優化選股及權重，打造兼具股息收益與股價成長機會的投資選擇。



## 相對台股市場較佳長期總報酬的投資新機會



資料來源：臺灣指數公司、Bloomberg，2009/1/5-2021/12/30。富蘭克林華美投信整理。上述四總報酬指數最晚者始於2009/1/5。\*股息報酬計算方式為總報酬指數減股價指數，股息報酬不代表股息率，股息報酬包含股息滾入再投資，且過去股息報酬不代表未來股息報酬。特選SMART多因子指數發布日期為2020/8/10，發行日前之資料為假設回測測試結果，非實際表現，並基於指數發行日當時採用之指數編製方式回溯。<以上資料包含指數回測結果，不代表基金投資組合或指數之實際報酬率及未來績效保證，實際表現可能與回測結果有所差異。基金不同於指數，基金可能有中途清算或合併等情形，投資人無法直接投資指數。>

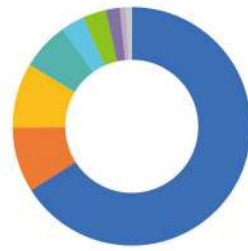


# FT臺灣Smart ETF

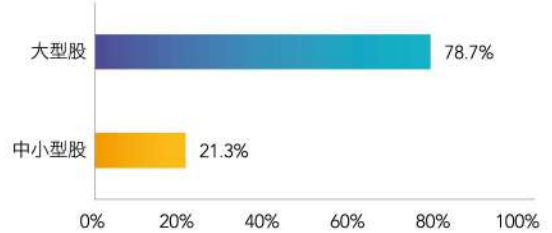
## 指數成分股資訊

前十大持股	指數權重	股票名稱	產業
2330	32.3%	台積電	資訊技術
2454	5.1%	聯發科	資訊技術
2317	4.4%	鴻海	資訊技術
2881	3.7%	富邦金	金融
2882	3.5%	國泰金	金融
2412	3.3%	中華電	通訊服務
6505	3.1%	台塑化	能源
1303	2.9%	南亞	原材料
2303	2.9%	聯電	資訊技術
1301	2.8%	台塑	原材料

指數成分產業比重



指數成分規模比重



資料來源：臺灣指數公司，2022/1/26。成分股市值按1000億以上為大型股、小於1000億為中小型股區分。

## 富蘭克林華美臺灣Smart ETF

富蘭克林華美臺灣Smart ETF基金				
基金名稱	富蘭克林華美臺灣Smart ETF基金			
基金簡稱	FT臺灣Smart ETF	最低申購金額	最低申購金額：新臺幣10,000元	
基金代號	00905	保管銀行	第一商業銀行	
基金經理人	李舒禾	經理費	淨資產價值級距	
追蹤指數	臺灣指數公司特選Smart 多因子指數		20億元(含)以下	經理費率
成分股數量	120檔 (截至2021/12/31)		逾20億元至50億元	0.45%
是否配息*	季配		50億元以上	0.30%
發行價格	發行價格：新臺幣10元	保管費	0.035%	
指數簡介	富蘭克林坦伯頓集團(Franklin Templeton Investments)旗下之富蘭克林顧問公司(Franklin Advisors, Inc., FAV)致力於研究多因子量化策略，將多因子模型結合傳統市值加權方法，利用多元財務、市場指標表彰投資因子特性，運用品質、價值以及動能等投資因子與市場權值股指標篩選成分股，再藉多因子量化模型分配權重，以增強投資績效表現；FAV提供指數選股方式及權重配置之專有方法，由臺灣指數公司酌量臺灣市場特性，設計指數編製規則，編製「臺灣指數公司特選Smart多因子指數」(簡稱「特選Smart多因子指數」)			

\*本基金可分配收益及詳細配息原則，請詳閱公開說明書。

### 富蘭克林華美投信獨立經營管理

本文提及之有價證券僅為舉例，非為有價證券之推介。本文提及之經濟走勢預測不必然代表本基金之績效。以上指數試算結果並非代表特定基金之投資成果，亦不代表對特定基金之買賣建議，基金不同於指數，基金可能有中途清算或合併等情形，投資人無法直接投資指數。本基金經金融監督管理委員會申報生效，惟不代表本基金絕無風險。基金經理公司以往之經理績效不保證本基金之最低投資收益；基金經理公司除盡善良管理人之注意義務外，不負責本基金之盈虧，亦不保證最低之收益，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。本基金自上市日起以追蹤標的指數之績效表現為投資目標，基金之投資績效將視其追蹤之標的指數之走勢而定，當標的指數波動劇烈時，基金之淨資產價值將有較大的波動風險。本基金雖以追蹤標的指數為操作目標，然下列因素仍可能使本基金報酬偏離標的指數報酬，且偏離方向無法預估：(一)本基金可能因應申贖或維持所需曝險比例等因素，需每日進行基金曝險調整，故基金淨值將受到每日交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費、上市費等)、投資組合成分價格波動或基金整體曝險比例等因素之影響，而使基金報酬與投資目標產生偏離。(二)本基金投資組合與標的指數相關性，將受到基金持有之有價證券或期貨與標的指數之相關性等因素影響。此外，基金投資組合中持有的期貨部位，因期貨的「價格發現」功能使其對市場信息、多空走勢之價格反應可能不同於債券，因此當市場出現特定信息時，基金淨值將同時承受期貨及債券對市場信息反應不一所產生的價格波動影響，可能使本基金報酬將與投資目標產生偏離。(三)本基金以新臺幣計價，而本基金所投資的有價證券或期貨標的的可能為新臺幣以外之計價貨幣，因此本基金承受相關匯率波動風險可能使本基金報酬與投資目標產生偏離。本基金自成立日起至上市日前(不含當日)，經理公司不接受本基金受益權單位之申購及贖回。「臺灣指數公司特選Smart多因子指數」係由臺灣指數股份有限公司編製及計算；惟「富蘭克林華美臺灣Smart ETF」並非由臺灣指數股份有限公司贊助、認可、銷售或推廣，且臺灣指數股份有限公司不直接使用「臺灣指數公司特選Smart多因子指數」或該指數於任何特定日期、時間所代表數字之預期結果提供任何明示或默示之擔保或聲明。與指數值及其成分股清單有關之一切著作權均歸臺灣指數股份有限公司所有。富蘭克林華美證券投資信託股份有限公司業已就使用該著作權發行「富蘭克林華美臺灣Smart ETF」之行為，自臺灣指數股份有限公司取得完整之使用授權。本基金不受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障。故投資本基金可能發生部分或全部本金之損失，最大可能損失則為全部投資金額。金融消費爭議處理及申訴管道：就本公司所提供之金融商品或服務所生紛爭投資人應先向本公司提出申訴，若三十日內未獲回覆或投資人不滿意處理結果得於六十日內向「金融消費評議中心」申請評議。有關基金應負擔之費用已揭露於基金公開說明書或簡式公開說明書中，投資人可向經理公司及基金銷售機構索取，或至公開資訊觀測站及經理公司網站中查詢。

富蘭克林華美證券投資信託股份有限公司 110金管投信新字第010號

臺北市忠孝東路四段87號12樓 | 電話：(02)2781-9599 | 傳真：(02)2781-8299 | 諮詢專線：0800-088-899 | 網址：www.FTFT.com.tw