

富時亞洲研究部 2011年7月

彭杰明
董事, 指數研究
jamie.perrett@ftse.com
+852 2164 3221

康佑明, Ph.D., ASA
副董事, 指數研究
frank.kang@ftse.com
+852 2164 3222

馬珮珊, CFA
計量研究經理
betty.ma@ftse.com
+852 2164 3223

陳家俊, FRM
研究分析師
edwin.chan@ftse.com
+852 2164 3242

梁凱傑
研究員
leung.hoikit@ftse.com
+852 2164 3224

吳廣熹
研究員
eddie.ngkwonghei@ftse.com
+852 2164 3225

葉力滌
研究員
tony.yip@ftse.com
+852 2164 3232

三井住友金融集團(8316)、東京海上控股(8766)及三井住友信託控股(8309)將分別於本次調整中佔富時價值股份日本指數雙向變動權重之5.00%、5.00%及4.47%

調整概述

富時價值股份日本指數採用獨特的價值投資策略, 配合透明、規範的投資方法, 為投資優質的價值型股票提供了機會。指數結合了富時獲全球公認的指數管理專長, 以及惠理集團成績卓越的嚴謹價值投資方法。其價值選股機制由惠理指數有限公司編制, 而指數由富時集團計算及管理。指數涵蓋35隻於東京證券交易所及大阪證券交易所上市且交投活躍和流通性高的優質價值型日本股票。

富時價值股份日本指數於7月調整後, 三井住友金融集團(8316)、東京海上控股(8766)及三井住友信託控股(8309)等18家公司將納入富時價值股份日本指數, 同時剔除包括本田汽車(7267)、三菱UFJ金融集團(8306)及普利司通(5108)在內的17隻指數成份股, 以上變動將於2011年7月19日生效。本次指數之雙向變動權重預計為92.21%。

主要變動概述如下:

表一: 富時價值股份日本指數成份股權重分析

排名	股票代碼	成份股名稱	ICB 從屬行業	指數調整前之權重 (%)	指數調整後之權重 (%)	權重變化 (%)	雙向變動權重 (%)
1	9433	KDDI	移動電信服務	5.48	5.00	-0.48	0.48
2	9432	日本電信電話	固定線路電信服務	5.14	5.00	-0.14	0.14
3	9437	NTT Docomo	移動電信服務	5.03	5.00	-0.03	0.03
4	4502	武田藥品	製藥	4.88	5.00	0.12	0.12
5	8053	住友商事	工業供應商	4.29	5.00	0.71	0.71
6	8316	三井住友金融集團	銀行	-	5.00	5.00	5.00
7	8766	東京海上控股	財產及人身保險	-	5.00	5.00	5.00
8	9022	東海旅客鐵道	旅遊和觀光	4.25	5.00	0.75	0.75
9	8309	三井住友信託控股	銀行	-	4.47	4.47	4.47
10	5201	旭硝子玻璃	建築材料和設備	3.48	4.09	0.61	0.61
11	7741	Hoya	電子設備	3.36	3.95	0.59	0.59
12	5713	住友金屬礦山	有色金屬	3.20	3.76	0.56	0.56
13	8002	日本丸紅	工業供應商	3.05	3.58	0.54	0.54
14	8035	東京電子	半導體	-	2.98	2.98	2.98
15	1878	大東建託	大型建築	2.39	2.81	0.42	0.42
16	3407	旭化成	一般化工製品	2.37	2.79	0.42	0.42
17	6988	日東電工	特殊化工用品	2.24	2.63	0.39	0.39
18	4005	住友化學工業	一般化工製品	-	2.45	2.45	2.45
19	3405	可樂麗	一般化工製品	-	2.25	2.25	2.25
20	1925	大和房屋工業	住宅建築	-	2.25	2.25	2.25
21	6762	東京電氣化學	電器元件和設備	-	2.12	2.12	2.12
22	8332	橫濱銀行	銀行	1.73	2.03	0.30	0.30
23	7270	富士重工業	汽車	-	1.81	1.81	1.81
24	4507	鹽野義製藥	製藥	-	1.73	1.73	1.73
25	6448	日本兄弟工業	辦公自動化設備	1.40	1.65	0.25	0.25
26	3861	王子製紙	造紙	1.34	1.58	0.24	0.24
27	4307	野村綜合研究所	計算機服務	-	1.52	1.52	1.52
28	8354	福岡金融集團	銀行	-	1.46	1.46	1.46
29	3401	帝人	一般化工製品	-	1.28	1.28	1.28
30	6302	住友重機械工業	工業機械	-	1.23	1.23	1.23
31	5711	三菱材料	綜合工業	-	1.22	1.22	1.22
32	7013	石川島播磨重工業	綜合工業	-	1.12	1.12	1.12
33	5202	日本板硝子	建築材料和設備	-	1.11	1.11	1.11
34	4183	三井化學	一般化工製品	0.92	1.09	0.16	0.16
35	4182	三菱瓦斯化學	一般化工製品	-	1.04	1.04	1.04
-	7267	本田汽車	汽車	5.18	-	-5.18	5.18

註: 7月調整後被納入的成份股顯示為藍色, 而被剔除的成份股顯示為紅色

資料來源: 富時集團, 截至2011年7月8日

富時價值股份指數

富時價值股份日本指數定期調整分析 - 2011年7月

續表一：富時價值股份日本指數成份股權重分析

排名	股票代碼	成份股名稱	ICB 從屬行業	指數調整前之權重 (%)	指數調整後之權重 (%)	權重變化 (%)	雙向變動權重 (%)
-	8306	三菱UFJ金融集團	銀行	5.06	-	-5.06	5.06
-	5108	普利司通	輪胎	4.88	-	-4.88	4.88
-	5411	JFE	鐵和鋼鐵	4.13	-	-4.13	4.13
-	9531	東京煤氣	天然氣分銷	3.13	-	-3.13	3.13
-	6702	富士通	計算機硬件	3.07	-	-3.07	3.07
-	5802	住友電氣工業	汽車零件	2.95	-	-2.95	2.95
-	4523	衛材製藥	製藥	2.86	-	-2.86	2.86
-	4188	三菱化學	特殊化工用品	2.71	-	-2.71	2.71
-	7202	五十鈴汽車	商業用車和貨車	2.02	-	-2.02	2.02
-	5406	神戶鋼鐵	鐵和鋼鐵	1.77	-	-1.77	1.77
-	9104	商船三井	海上運輸	1.65	-	-1.65	1.65
-	9101	日本郵船	海上運輸	1.60	-	-1.60	1.60
-	8331	千葉銀行	銀行	1.41	-	-1.41	1.41
-	4185	JSR	特殊化工用品	1.28	-	-1.28	1.28
-	8333	常陽銀行	銀行	0.88	-	-0.88	0.88
-	6417	三共	博彩	0.85	-	-0.85	0.85
合計			-	100.00	100.00	-	92.21

註：7月調整後被納入的成份股顯示為藍色，而被剔除的成份股顯示為紅色
資料來源：富時集團，截至2011年7月8日

本田汽車(7267)、三菱UFJ金融集團(8306)及普利司通(5108)於富時價值股份日本指數調整前之權重分別為5.18%、5.06%及4.88%

表二：富時價值股份日本指數行業分析

ICB 產業 / 行業	指數調整後的成份股數量	成份股變動	指數調整前之權重 (%)	指數調整後之權重 (%)	權重變化 (%)	雙向變動權重 (%)
基礎材料	9	0	19.96	18.87	-1.10	18.68
化工製品	7	2	9.52	13.53	4.01	11.98
林業和造紙	1	0	1.34	1.58	0.24	0.24
工業金屬和礦業	1	-2	9.10	3.76	-5.34	6.47
工業	10	2	21.84	26.23	4.39	14.94
建築和材料	3	1	5.86	8.00	2.14	2.14
一般工業	2	2	0.00	2.35	2.35	2.35
電子和電器設備	2	1	3.36	6.07	2.71	2.71
工業工程	1	0	2.02	1.23	-0.80	3.25
運輸	0	-2	3.25	0.00	-3.25	3.25
輔助服務	2	0	7.34	8.58	1.24	1.24
生活消費品	2	-1	13.02	4.06	-8.96	17.08
汽車和零件	1	-2	13.02	1.81	-11.21	14.83
家庭用品及住宅建築	1	1	0.00	2.25	2.25	2.25
衛生保健	2	0	7.74	6.73	-1.01	4.71
製藥和生物科技	2	0	7.74	6.73	-1.01	4.71
消費服務	1	-1	5.10	5.00	-0.11	1.60
旅遊和休閒	1	-1	5.10	5.00	-0.11	1.60
電信服務	3	0	15.65	15.00	-0.65	0.65
固定線路電信服務	1	0	5.14	5.00	-0.14	0.14
移動電信服務	2	0	10.51	10.00	-0.51	0.51
公用事業	0	-1	3.13	0.00	-3.13	3.13
天然氣、水和多用途設施	0	-1	3.13	0.00	-3.13	3.13
金融	5	1	9.08	17.96	8.88	23.59
銀行	4	0	9.08	12.96	3.88	18.59
非人壽保險	1	1	0.00	5.00	5.00	5.00
科技	3	1	4.48	6.15	1.68	7.82
軟件和計算機服務	1	1	0.00	1.52	1.52	1.52
科技硬件和設備	2	0	4.48	4.63	0.15	6.30
合計	35	35	100.00	100.00	-	92.21

資料來源：富時集團，截至2011年7月8日

非人壽保險將有最大的行業權重變化，增長5.00%

汽車和零件將有最大的行業權重跌幅，下降11.21%至1.81%

富時價值股份指數

富時價值股份日本指數定期調整分析 - 2011 年 7 月



免責聲明

© 2011 年富時國際有限公司 ("富時集團") 版權所有。保留所有權利。富時價值股份中國指數 (FTSE Value-Stocks China Index)、富時價值股份韓國指數 (FTSE Value-Stocks Korea Index)、富時價值股份台灣指數 (FTSE Value-Stocks Taiwan Index) 及富時價值股份日本指數 (FTSE Value-Stocks Japan Index) 是由富時集團計算的定制指數。指數 (Indices) 中的所有權利均歸富時集團所有。"FTSE®" 是倫敦證券交易所和金融時報有限公司的商標，由富時集團根據授權使用。所有資料僅以提供信息為目的，對於因使用本出版物導致的任何失誤或損失，富時集團不承擔任何責任。未經富時集團事先許可，不得複製本出版物的任何部分，也不得將本出版物的任何部分存儲於任何檢索系統，不得以任何形式或方式 (不論是電子、機械、影印、錄製還是其它方式) 傳播本出版物的任何部分。發布富時集團指數值和使用富時集團指數來創造金融產品需得到富時集團和 / 或其許可方的許可。行業分類標準 (Industry Classification Benchmark, 簡稱 ICB) 是富時產品。ICB 的所有知識產權均歸富時集團所有，使用 ICB 需得到富時集團的許可。對於任何人因 ICB 中的任何錯誤或信息遺漏導致的任何損失或損害，富時集團不承擔任何責任。

FOR FURTHER INFORMATION VISIT WWW.FTSE.COM, EMAIL INFO@FTSE.COM OR CALL YOUR LOCAL FTSE OFFICE:
BOSTON: +1 888 747 FTSE (3873) CHINA (NORTH): 10800 852 1727 CHINA (SOUTH): 10800 152 1727
FRANKFURT: +49 (0)69 156 85 144 HONG KONG: +852 2164 3333 LONDON: +44 (0)20 7866 1810
MADRID: +34 91 411 3787 MALAYSIA: 1800 812 116 MILAN: +39 02 7242 6641 NEW YORK: +1 888 747 FTSE (3873)
PARIS: +33 (0)1 53 76 82 88 SAN FRANCISCO: +1 888 747 FTSE(3873) SINGAPORE: 800 8523 654
SYDNEY: +61 2 9293 2864 TAIWAN: 0080 185 6152 THAILAND: 001 800 852 5111 TOKYO: +81 3 3581 2811

