

富时价值股份指数

富时价值股份日本指数定期调整分析 - 2011年7月

富时亚洲研究部 2011年7月

彭杰明
董事, 指数研究
jamie.perrett@ftse.com
+852 2164 3221

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

马珮珊, CFA
计量研究经理
betty.ma@ftse.com
+852 2164 3223

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

梁凯杰
研究员
leung.hoikit@ftse.com
+852 2164 3224

吴广熹
研究员
eddie.ngkwonghei@ftse.com
+852 2164 3225

叶力滢
研究员
tony.yip@ftse.com
+852 2164 3232

三井住友金融集团(8316)、东京海上控股(8766)及三井住友信託控股(8309)将分别于本次调整中占富时价值股份日本指数双向变动权重之5.00%、5.00%及4.47%

调整概述

富时价值股份日本指数采用独特的价值投资策略, 配合透明、规范的投资方法, 为投资优质的价值型股票提供了机会。指数结合了富时获全球公认的指数管理专长, 以及惠理集团成绩卓越的严谨价值投资方法。其价值选股机制由惠理指数有限公司编制, 而指数由富时集团计算及管理。指数涵盖35只于东京证券交易所及大阪证券交易所上市且交投活跃和流通性高的优质价值型日本股票。

富时价值股份日本指数于7月调整后, 三井住友金融集团(8316)、东京海上控股(8766)及三井住友信託控股(8309)等18家公司将纳入富时价值股份日本指数, 同时剔除包括本田汽车(7267)、三菱UFJ金融集团(8306)及普利司通(5108)在内的17隻指数成份股, 以上变动将于2011年7月19日生效。本次指数之双向变动权重预计为92.21%。

主要变动概述如下:

表一: 富时价值股份日本指数成份股权重分析

| 排名 | 股票代码 | 成份股名称 | ICB 从属行业 | 指数调整前之权重 (%) | 指数调整后之权重 (%) | 权重变化 (%) | 双向变动权重 (%) |
|----|------|------------|----------|--------------|--------------|----------|------------|
| 1 | 9433 | KDDI | 移动通信服务 | 5.48 | 5.00 | -0.48 | 0.48 |
| 2 | 9432 | 日本电信电话 | 固定线路电信服务 | 5.14 | 5.00 | -0.14 | 0.14 |
| 3 | 9437 | NTT Docomo | 移动通信服务 | 5.03 | 5.00 | -0.03 | 0.03 |
| 4 | 4502 | 武田药品 | 制药 | 4.88 | 5.00 | 0.12 | 0.12 |
| 5 | 8053 | 住友商事 | 工业供应商 | 4.29 | 5.00 | 0.71 | 0.71 |
| 6 | 8316 | 三井住友金融集团 | 银行 | - | 5.00 | 5.00 | 5.00 |
| 7 | 8766 | 东京海上控股 | 财产及人身保险 | - | 5.00 | 5.00 | 5.00 |
| 8 | 9022 | 东海旅客铁道 | 旅游和观光 | 4.25 | 5.00 | 0.75 | 0.75 |
| 9 | 8309 | 三井住友信託控股 | 银行 | - | 4.47 | 4.47 | 4.47 |
| 10 | 5201 | 旭硝子玻璃 | 建筑材料和设备 | 3.48 | 4.09 | 0.61 | 0.61 |
| 11 | 7741 | Hoya | 电子设备 | 3.36 | 3.95 | 0.59 | 0.59 |
| 12 | 5713 | 住友金属矿山 | 有色金属 | 3.20 | 3.76 | 0.56 | 0.56 |
| 13 | 8002 | 日本丸红 | 工业供应商 | 3.05 | 3.58 | 0.54 | 0.54 |
| 14 | 8035 | 东京电子 | 半导体 | - | 2.98 | 2.98 | 2.98 |
| 15 | 1878 | 大东建托 | 大型建筑 | 2.39 | 2.81 | 0.42 | 0.42 |
| 16 | 3407 | 旭化成 | 一般化工制品 | 2.37 | 2.79 | 0.42 | 0.42 |
| 17 | 6988 | 日东电工 | 特殊化工用品 | 2.24 | 2.63 | 0.39 | 0.39 |
| 18 | 4005 | 住友化学工业 | 一般化工制品 | - | 2.45 | 2.45 | 2.45 |
| 19 | 3405 | 可乐丽 | 一般化工制品 | - | 2.25 | 2.25 | 2.25 |
| 20 | 1925 | 大和房屋工业 | 住宅建筑 | - | 2.25 | 2.25 | 2.25 |
| 21 | 6762 | 东京电气化学 | 电器元件和设备 | - | 2.12 | 2.12 | 2.12 |
| 22 | 8332 | 横滨银行 | 银行 | 1.73 | 2.03 | 0.30 | 0.30 |
| 23 | 7270 | 富士重工业 | 汽车 | - | 1.81 | 1.81 | 1.81 |
| 24 | 4507 | 盐野义制药 | 制药 | - | 1.73 | 1.73 | 1.73 |
| 25 | 6448 | 日本兄弟工业 | 办公自动化设备 | 1.40 | 1.65 | 0.25 | 0.25 |
| 26 | 3861 | 王子制纸 | 造纸 | 1.34 | 1.58 | 0.24 | 0.24 |
| 27 | 4307 | 野村综合研究所 | 计算机服务 | - | 1.52 | 1.52 | 1.52 |
| 28 | 8354 | 福冈金融集团 | 银行 | - | 1.46 | 1.46 | 1.46 |
| 29 | 3401 | 帝人 | 一般化工制品 | - | 1.28 | 1.28 | 1.28 |
| 30 | 6302 | 住友重机械工业 | 工业机械 | - | 1.23 | 1.23 | 1.23 |
| 31 | 5711 | 三菱材料 | 综合工业 | - | 1.22 | 1.22 | 1.22 |
| 32 | 7013 | 石川岛播磨重工业 | 综合工业 | - | 1.12 | 1.12 | 1.12 |
| 33 | 5202 | 日本板硝子 | 建筑材料和设备 | - | 1.11 | 1.11 | 1.11 |
| 34 | 4183 | 三井化学 | 一般化工制品 | 0.92 | 1.09 | 0.16 | 0.16 |
| 35 | 4182 | 三菱瓦斯化学 | 一般化工制品 | - | 1.04 | 1.04 | 1.04 |
| - | 7267 | 本田汽车 | 汽车 | 5.18 | - | -5.18 | 5.18 |

注: 7月调整后被纳入的成份股显示为蓝色, 而被剔除的成份股显示为红色

资料来源: 富时集团, 截至2011年7月8日

续表一：富时价值股份日本指数成份股权重分析

| 排名 | 股票代码 | 成份股名称 | ICB 从属行业 | 指数调整前 之权重 (%) | 指数调整后 之权重 (%) | 权重变化 (%) | 双向变动 权重 (%) |
|----|------|-----------|----------|------------------|------------------|-------------|-------------------|
| - | 8306 | 三菱UFJ金融集团 | 银行 | 5.06 | - | -5.06 | 5.06 |
| - | 5108 | 普利司通 | 轮胎 | 4.88 | - | -4.88 | 4.88 |
| - | 5411 | JFE | 铁和钢铁 | 4.13 | - | -4.13 | 4.13 |
| - | 9531 | 东京煤气 | 天然气分销 | 3.13 | - | -3.13 | 3.13 |
| - | 6702 | 富士通 | 计算机硬件 | 3.07 | - | -3.07 | 3.07 |
| - | 5802 | 住友电气工业 | 汽车零件 | 2.95 | - | -2.95 | 2.95 |
| - | 4523 | 卫材制药 | 制药 | 2.86 | - | -2.86 | 2.86 |
| - | 4188 | 三菱化学 | 特殊化工用品 | 2.71 | - | -2.71 | 2.71 |
| - | 7202 | 五十铃汽车 | 商业用车和货车 | 2.02 | - | -2.02 | 2.02 |
| - | 5406 | 神户制钢 | 铁和钢铁 | 1.77 | - | -1.77 | 1.77 |
| - | 9104 | 商船三井 | 海上运输 | 1.65 | - | -1.65 | 1.65 |
| - | 9101 | 日本邮船 | 海上运输 | 1.60 | - | -1.60 | 1.60 |
| - | 8331 | 千叶银行 | 银行 | 1.41 | - | -1.41 | 1.41 |
| - | 4185 | JSR | 特殊化工用品 | 1.28 | - | -1.28 | 1.28 |
| - | 8333 | 常阳银行 | 银行 | 0.88 | - | -0.88 | 0.88 |
| - | 6417 | 三共 | 博彩 | 0.85 | - | -0.85 | 0.85 |
| | | 合计 | - | 100.00 | 100.00 | - | 92.21 |

注：7月调整后被纳入的成份股显示为蓝色，而被剔除的成份股显示为红色
资料来源：富时集团，截至2011年7月8日

表二：富时价值股份日本指数行业分析

| ICB 产业 / 行业 | 指数调整后的成份 股数量 | 成份股变动 | 指数调整前之 权重 (%) | 指数调整后之 权重 (%) | 权重变化 (%) | 双向变动权重 (%) |
|-------------|-----------------|-------|------------------|------------------|----------|---------------|
| 基础材料 | 9 | 0 | 19.96 | 18.87 | -1.10 | 18.68 |
| 化工制品 | 7 | 2 | 9.52 | 13.53 | 4.01 | 11.98 |
| 林业和造纸 | 1 | 0 | 1.34 | 1.58 | 0.24 | 0.24 |
| 工业金属和矿业 | 1 | -2 | 9.10 | 3.76 | -5.34 | 6.47 |
| 工业 | 10 | 2 | 21.84 | 26.23 | 4.39 | 14.94 |
| 建筑和材料 | 3 | 1 | 5.86 | 8.00 | 2.14 | 2.14 |
| 一般工业 | 2 | 2 | 0.00 | 2.35 | 2.35 | 2.35 |
| 电子和电气设备 | 2 | 1 | 3.36 | 6.07 | 2.71 | 2.71 |
| 工业工程 | 1 | 0 | 2.02 | 1.23 | -0.80 | 3.25 |
| 运输 | 0 | -2 | 3.25 | 0.00 | -3.25 | 3.25 |
| 辅助服务 | 2 | 0 | 7.34 | 8.58 | 1.24 | 1.24 |
| 生活消费品 | 2 | -1 | 13.02 | 4.06 | -8.96 | 17.08 |
| 汽车和零件 | 1 | -2 | 13.02 | 1.81 | -11.21 | 14.83 |
| 家庭用品及住宅建筑 | 1 | 1 | 0.00 | 2.25 | 2.25 | 2.25 |
| 卫生保健 | 2 | 0 | 7.74 | 6.73 | -1.01 | 4.71 |
| 制药和生物科技 | 2 | 0 | 7.74 | 6.73 | -1.01 | 4.71 |
| 消费服务 | 1 | -1 | 5.10 | 5.00 | -0.11 | 1.60 |
| 旅游和休闲 | 1 | -1 | 5.10 | 5.00 | -0.11 | 1.60 |
| 电信服务 | 3 | 0 | 15.65 | 15.00 | -0.65 | 0.65 |
| 固定线路电信服务 | 1 | 0 | 5.14 | 5.00 | -0.14 | 0.14 |
| 移动电话服务 | 2 | 0 | 10.51 | 10.00 | -0.51 | 0.51 |
| 公用事业 | 0 | -1 | 3.13 | 0.00 | -3.13 | 3.13 |
| 天然气、水和多用途设施 | 0 | -1 | 3.13 | 0.00 | -3.13 | 3.13 |
| 金融 | 5 | 1 | 9.08 | 17.96 | 8.88 | 23.59 |
| 银行 | 4 | 0 | 9.08 | 12.96 | 3.88 | 18.59 |
| 非人寿保险 | 1 | 1 | 0.00 | 5.00 | 5.00 | 5.00 |
| 科技 | 3 | 1 | 4.48 | 6.15 | 1.68 | 7.82 |
| 软件和计算机服务 | 1 | 1 | 0.00 | 1.52 | 1.52 | 1.52 |
| 科技硬件和设备 | 2 | 0 | 4.48 | 4.63 | 0.15 | 6.30 |
| 合计 | 35 | 35 | 100.00 | 100.00 | - | 92.21 |

资料来源：富时集团，截至2011年7月8日

本田汽车(7267)、三菱UFJ金融集团(8306)及普利司通(5108)于富时价值股份日本指数调整前之权重分别为5.18%、5.06%及4.88%

非人寿保险将有最大的行业权重变化，增长5.00%

汽车和零件将有最大的行业权重跌幅，下降11.21%至1.81%

富时价值股份指数

富时价值股份日本指数定期调整分析 - 2011 年 7 月



免责声明

© 2011 年富时国际有限公司 ("富时集团") 版权所有。保留所有权利。富时价值股份中国指数 (FTSE Value-Stocks China Index)、富时价值股份韩国指数 (FTSE Value-Stocks Korea Index)、富时价值股份台湾指数 (FTSE Value-Stocks Taiwan Index) 及富时价值股份日本指数 (FTSE Value-Stocks Japan Index) 是由富时集团计算的定制指数。指数 (Indices) 中的所有权利均归富时集团所有。"FTSE®" 是伦敦证券交易所和金融时报有限公司的商标，由富时集团根据授权使用。所有资料仅以提供信息为目的，对于因使用本出版物导致的任何失误或损失，富时集团不承担任何责任。未经富时集团事先许可，不得复制本出版物的任何部分，也不得将本出版物的任何部分存储于任何检索系统，不得以任何形式或方式 (不论是电子、机械、影印、录制还是其它方式) 传播本出版物的任何部分。发布富时集团指数值和使用富时集团指数来创造金融产品需得到富时集团和 / 或其许可方的许可。行业分类标准 (Industry Classification Benchmark, 简称 ICB) 是富时产品。ICB 的所有知识产权均归富时集团所有，使用 ICB 需得到富时集团的许可。对于任何人因 ICB 中的任何错误或信息遗漏导致的任何损失或损害，富时集团不承担任何责任。

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

