

富時研究部 2011年9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

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

HTC(2498)、台達電子(2308)
及台塑石化(6505)將於本次
調整中佔富時價值股份台灣
指數雙向變動權重之
10.00%、3.41%及2.87%

調整概述

富時價值股份台灣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50隻於臺灣證券交易所及證券櫃檯買賣中心上市且交投活躍和流通性高的優質價值型台灣股票。

富時價值股份台灣指數於9月調整後，HTC(2498)、台達電子(2308)及台塑石化(6505)等11家公司將納入富時價值股份台灣指數，同時剔除包括聯華電子(2303)、元大金融(2885)及宏碁(2353)在內的11隻指數成份股，以上變動將於2011年9月19日生效。本次指數之雙向變動權重預計為44.28%。

主要變動概述如下：

表一：富時價值股份台灣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	2498	HTC	電信設備	-	10.00	10.00	10.00
2	2330	台灣積體電路	半導體	10.68	10.00	-0.68	0.68
3	1303	南亞塑膠工業	一般化工製品	9.54	9.55	0.02	0.02
4	1301	台灣塑膠工業	一般化工製品	8.59	9.36	0.77	0.77
5	1326	台灣化學纖維	一般化工製品	7.69	6.55	-1.14	1.14
6	2002	中國鋼鐵	鐵和鋼鐵	6.85	6.18	-0.67	0.67
7	2881	富邦金融	人壽保險	5.60	4.77	-0.83	0.83
8	2891	中國信託金融	銀行	4.73	4.32	-0.41	0.41
9	2308	台達電子	電子設備	-	3.41	3.41	3.41
10	2357	華碩電腦	計算機硬件	3.97	3.38	-0.59	0.59
11	2311	日月光半導體製造	半導體	2.88	3.27	0.39	0.39
12	6505	台塑石化	勘探和生產	-	2.87	2.87	2.87
13	2105	正新橡膠工業	輪胎	2.76	2.35	-0.41	0.41
14	2324	仁寶電腦	計算機硬件	2.73	2.32	-0.40	0.40
15	5854	合作金庫商業銀行	銀行	2.04	1.74	-0.30	0.30
16	3697	晨星半導體	半導體	-	1.54	1.54	1.54
17	3702	大聯大投資	半導體	1.41	1.20	-0.21	0.21
18	3037	欣興電子	電器元件和設備	1.39	1.19	-0.21	0.21
19	9904	寶成工業	鞋類	1.36	1.16	-0.20	0.20
20	2103	台橡股份	一般化工製品	1.12	0.96	-0.17	0.17
21	6239	力成科技	半導體	1.12	0.95	-0.17	0.17
22	2337	旺宏電子	半導體	0.88	0.75	-0.13	0.13
23	2395	研華股份	計算機硬件	0.72	0.62	-0.11	0.11
24	2615	萬海航運	海上運輸	-	0.61	0.61	0.61
25	2015	豐興鋼鐵	鐵和鋼鐵	-	0.60	0.60	0.60
26	3034	聯詠科技	半導體	0.71	0.60	-0.11	0.11
27	1504	東元電機	耐用家庭用品	0.71	0.60	-0.11	0.11
28	9921	巨大機械工業	休閒產品	0.68	0.58	-0.10	0.10
29	1704	李長榮化學工業	特殊化工用品	-	0.57	0.57	0.57
30	2385	群光電子	計算機硬件	0.67	0.57	-0.10	0.10
31	5483	中美矽晶製品	半導體	0.57	0.48	-0.08	0.08
32	3189	景碩科技	半導體	0.50	0.43	-0.07	0.07
33	8299	群聯電子	計算機硬件	0.50	0.42	-0.07	0.07
34	2379	瑞昱半導體	半導體	0.49	0.42	-0.07	0.07
35	6286	立錫科技	半導體	0.47	0.40	-0.07	0.07
36	2393	億光電子工業	電器元件和設備	0.47	0.40	-0.07	0.07

註：9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9月9日

續表一：富時價值股份台灣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 (%)
37	2006	東和鋼鐵	鐵和鋼鐵	0.47	0.40	-0.07	0.07
38	1507	永大機電工業	工業機械	0.46	0.39	-0.07	0.07
39	6153	嘉聯益科技	電器元件和設備	0.43	0.36	-0.06	0.06
40	2606	裕民航運	海上運輸	0.42	0.36	-0.06	0.06
41	2327	國巨股份	電器元件和設備	0.42	0.36	-0.06	0.06
42	9939	宏全國際	容器和包裝	0.41	0.36	-0.06	0.06
43	2360	致茂電子	電子設備	-	0.36	0.36	0.36
44	2106	建大工業	輪胎	-	0.35	0.35	0.35
45	6244	茂迪股份	可再生能源設備	0.40	0.34	-0.06	0.06
46	2548	華固建設	房地產及其開發	-	0.34	0.34	0.34
47	1717	長興化學工業	特殊化工用品	0.39	0.33	-0.06	0.06
48	2601	益航股份	海上運輸	-	0.32	0.32	0.32
49	2376	技嘉科技	半導體	0.36	0.31	-0.05	0.05
50	5522	遠雄建設	房地產及其開發	0.35	0.30	-0.05	0.05
-	2303	聯華電子	半導體	3.12	-	-3.12	3.12
-	2885	元大金融	投資服務	3.06	-	-3.06	3.06
-	2353	宏碁	計算機硬件	2.13	-	-2.13	2.13
-	2890	永豐金融	銀行	1.59	-	-1.59	1.59
-	3231	緯創資通	計算機硬件	1.57	-	-1.57	1.57
-	2448	晶元光電	半導體	1.01	-	-1.01	1.01
-	2392	正崙精密工業	電器元件和設備	0.55	-	-0.55	0.55
-	1319	東陽實業	汽車零件	0.34	-	-0.34	0.34
-	2489	瑞軒科技	消費性電器用品	0.29	-	-0.29	0.29
-	3622	洋華光電	電器元件和設備	0.20	-	-0.20	0.20
-	3519	綠能科技	可再生能源設備	0.18	-	-0.18	0.18
合計				100.00	100.00	-	44.28

註：9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9月9日

聯華電子(2303)、元大金融(2885)及宏碁(2353)於富時價值股份台灣指數調整前之權重分別為3.12%、3.06%及2.13%

表二：富時價值股份台灣指數行業分析

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 (%)
石油和天然氣	2	0	0.59	3.21	2.62	3.11
石油和天然氣生產商	1	1	0.00	2.87	2.87	2.87
替代能源	1	-1	0.59	0.34	-0.24	0.24
基礎材料	9	2	34.65	34.51	-0.14	4.07
化工製品	6	1	27.33	27.33	0.00	2.73
工業金屬和礦業	3	1	7.32	7.18	-0.14	1.34
工業	11	2	4.76	8.11	3.34	6.04
一般工業	1	0	0.41	0.36	-0.06	0.06
電子和電器設備	6	0	3.47	6.07	2.61	4.93
工業工程	1	0	0.46	0.39	-0.07	0.07
運輸	3	2	0.42	1.29	0.86	0.99
生活消費品	5	-1	6.14	5.04	-1.09	1.80
汽車和零件	2	0	3.10	2.70	-0.40	1.10
家庭用品及住宅建築	1	0	0.71	0.60	-0.11	0.11
休閒用品	1	-1	0.97	0.58	-0.39	0.39
個人消費品	1	0	1.36	1.16	-0.20	0.20
金融	5	-1	17.37	11.46	-5.91	6.59
銀行	2	-1	8.36	6.06	-2.30	2.30
人壽保險	1	0	5.60	4.77	-0.83	0.83
房地產投資與服務	2	1	0.35	0.64	0.29	0.39
金融服務	0	-1	3.06	0.00	-3.06	3.06
科技	18	-2	36.49	37.67	1.17	22.68
科技硬件和設備	18	-2	36.49	37.67	1.17	22.68
合計	50	22	100.00	100.00	-	44.28

資料來源：富時集團，截至2011年9月9日

石油和天然氣生產商將有最大的行業權重變化，增長2.87%

金融服務將有最大的行業權重跌幅，下降3.06%

富時價值股份指數

富時價值股份台灣指數定期調整分析 - 2011 年 9 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 A 股指數 (FTSE Value-Stocks China A-Share Index)、富時價值股份中國指數 (FTSE Value-Stocks China Index)、富時價值股份日本指數 (FTSE Value-Stocks Japan Index)、富時價值股份韓國指數 (FTSE Value-Stocks Korea Index) 及富時價值股份台灣指數 (FTSE Value-Stocks Taiwan 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。