

富时价值股份指数

富时价值股份台湾指数定期调整分析 - 2011年9月

富时研究部 2011年9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

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

HTC(2498)、台达电子(2308)
及台塑石化(6505)将于本次
调整中占富时价值股份台湾
指数双向变动权重之
10.00%、3.41%及2.87%

调整概述

富时价值股份台湾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50只于台湾证券交易所及证券柜台买卖中心上市且交投活跃和流通性高的优质价值型台湾股票。

富时价值股份台湾指数于9月调整后, HTC(2498)、台达电子(2308)及台塑石化(6505)等11家公司将纳入富时价值股份台湾指数, 同时剔除包括联华电子(2303)、元大金融(2885)及宏碁(2353)在内的11隻指数成份股, 以上变动将于2011年9月19日生效。本次指数之双向变动权重预计为44.28%。

主要变动概述如下:

表一: 富时价值股份台湾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	2498	HTC	电信设备	-	10.00	10.00	10.00
2	2330	台湾积体电路	半导体	10.68	10.00	-0.68	0.68
3	1303	南亚塑胶工业	一般化工制品	9.54	9.55	0.02	0.02
4	1301	台湾塑胶工业	一般化工制品	8.59	9.36	0.77	0.77
5	1326	台湾化学纤维	一般化工制品	7.69	6.55	-1.14	1.14
6	2002	中国钢铁	铁和钢铁	6.85	6.18	-0.67	0.67
7	2881	富邦金融	人寿保险	5.60	4.77	-0.83	0.83
8	2891	中国信托金融	银行	4.73	4.32	-0.41	0.41
9	2308	台达电子	电子设备	-	3.41	3.41	3.41
10	2357	华硕电脑	计算机硬件	3.97	3.38	-0.59	0.59
11	2311	日月光半导体制造	半导体	2.88	3.27	0.39	0.39
12	6505	台塑石化	勘探和生产	-	2.87	2.87	2.87
13	2105	正新橡胶工业	轮胎	2.76	2.35	-0.41	0.41
14	2324	仁宝电脑	计算机硬件	2.73	2.32	-0.40	0.40
15	5854	合作金库商业银行	银行	2.04	1.74	-0.30	0.30
16	3697	晨星半导体	半导体	-	1.54	1.54	1.54
17	3702	大联大投资	半导体	1.41	1.20	-0.21	0.21
18	3037	欣兴电子	电器元件和设备	1.39	1.19	-0.21	0.21
19	9904	宝成工业	鞋类	1.36	1.16	-0.20	0.20
20	2103	台橡股份	一般化工制品	1.12	0.96	-0.17	0.17
21	6239	力成科技	半导体	1.12	0.95	-0.17	0.17
22	2337	旺宏电子	半导体	0.88	0.75	-0.13	0.13
23	2395	研华股份	计算机硬件	0.72	0.62	-0.11	0.11
24	2615	万海航运	海上运输	-	0.61	0.61	0.61
25	2015	丰兴钢铁	铁和钢铁	-	0.60	0.60	0.60
26	3034	联咏科技	半导体	0.71	0.60	-0.11	0.11
27	1504	东元电机	耐用家庭用品	0.71	0.60	-0.11	0.11
28	9921	巨大机械工业	休闲产品	0.68	0.58	-0.10	0.10
29	1704	李长荣化学工业	特殊化工用品	-	0.57	0.57	0.57
30	2385	群光电子	计算机硬件	0.67	0.57	-0.10	0.10
31	5483	中美矽晶制品	半导体	0.57	0.48	-0.08	0.08
32	3189	景硕科技	半导体	0.50	0.43	-0.07	0.07
33	8299	群联电子	计算机硬件	0.50	0.42	-0.07	0.07
34	2379	瑞昱半导体	半导体	0.49	0.42	-0.07	0.07
35	6286	立錡科技	半导体	0.47	0.40	-0.07	0.07
36	2393	亿光电子工业	电器元件和设备	0.47	0.40	-0.07	0.07

注: 9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9月9日

续表一：富时价值股份台湾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 (%)
37	2006	东和钢铁	铁和钢铁	0.47	0.40	-0.07	0.07
38	1507	永大机电工业	工业机械	0.46	0.39	-0.07	0.07
39	6153	嘉联益科技	电器元件和设备	0.43	0.36	-0.06	0.06
40	2606	裕民航运	海上运输	0.42	0.36	-0.06	0.06
41	2327	国巨股份	电器元件和设备	0.42	0.36	-0.06	0.06
42	9939	宏全国际	容器和包装	0.41	0.36	-0.06	0.06
43	2360	致茂电子	电子设备	-	0.36	0.36	0.36
44	2106	建大工业	轮胎	-	0.35	0.35	0.35
45	6244	茂迪股份	可再生能源设备	0.40	0.34	-0.06	0.06
46	2548	华固建设	房地产及其开发	-	0.34	0.34	0.34
47	1717	长兴化学工业	特殊化工用品	0.39	0.33	-0.06	0.06
48	2601	益航股份	海上运输	-	0.32	0.32	0.32
49	2376	技嘉科技	半导体	0.36	0.31	-0.05	0.05
50	5522	远雄建设	房地产及其开发	0.35	0.30	-0.05	0.05
-	2303	联华电子	半导体	3.12	-	-3.12	3.12
-	2885	元大金融	投资服务	3.06	-	-3.06	3.06
-	2353	宏碁	计算机硬件	2.13	-	-2.13	2.13
-	2890	永丰金融	银行	1.59	-	-1.59	1.59
-	3231	纬创资通	计算机硬件	1.57	-	-1.57	1.57
-	2448	晶元光电	半导体	1.01	-	-1.01	1.01
-	2392	正崧精密工业	电器元件和设备	0.55	-	-0.55	0.55
-	1319	东阳实业	汽车零件	0.34	-	-0.34	0.34
-	2489	瑞轩科技	消费性电器用品	0.29	-	-0.29	0.29
-	3622	洋华光电	电器元件和设备	0.20	-	-0.20	0.20
-	3519	绿能科技	可再生能源设备	0.18	-	-0.18	0.18
合计				100.00	100.00	-	44.28

联华电子(2303)、元大金融(2885)及宏碁(2353)于富时价值股份台湾指数调整前之权重分别为3.12%、3.06%及2.13%

注：9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9月9日

表二：富时价值股份台湾指数行业分析

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 (%)
石油和天然气	2	0	0.59	3.21	2.62	3.11
石油和天然气生产商	1	1	0.00	2.87	2.87	2.87
替代能源	1	-1	0.59	0.34	-0.24	0.24
基础材料	9	2	34.65	34.51	-0.14	4.07
化工制品	6	1	27.33	27.33	0.00	2.73
工业金属和矿业	3	1	7.32	7.18	-0.14	1.34
工业	11	2	4.76	8.11	3.34	6.04
一般工业	1	0	0.41	0.36	-0.06	0.06
电子和电器设备	6	0	3.47	6.07	2.61	4.93
工业工程	1	0	0.46	0.39	-0.07	0.07
运输	3	2	0.42	1.29	0.86	0.99
生活消费品	5	-1	6.14	5.04	-1.09	1.80
汽车和零件	2	0	3.10	2.70	-0.40	1.10
家庭用品及住宅建筑	1	0	0.71	0.60	-0.11	0.11
休闲用品	1	-1	0.97	0.58	-0.39	0.39
个人消费品	1	0	1.36	1.16	-0.20	0.20
金融	5	-1	17.37	11.46	-5.91	6.59
银行	2	-1	8.36	6.06	-2.30	2.30
人寿保险	1	0	5.60	4.77	-0.83	0.83
房地产投资与服务	2	1	0.35	0.64	0.29	0.39
金融服务	0	-1	3.06	0.00	-3.06	3.06
科技	18	-2	36.49	37.67	1.17	22.68
科技硬件和设备	18	-2	36.49	37.67	1.17	22.68
合计	50	22	100.00	100.00	-	44.28

资料来源：富时集团，截至2011年9月9日

石油和天然气生产商将有最大的行业权重变化，增长2.87%

金融服务将有最大的行业权重跌幅，下降3.06%

富时价值股份指数

富时价值股份台湾指数定期调整分析 - 2011 年 9 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 A 股指数 (FTSE Value-Stocks China A-Share Index)、富时价值股份中国指数 (FTSE Value-Stocks China Index)、富时价值股份日本指数 (FTSE Value-Stocks Japan Index)、富时价值股份韩国指数 (FTSE Value-Stocks Korea Index) 及富时价值股份台湾指数 (FTSE Value-Stocks Taiwan 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、录影还是其它方式）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

