

富時亞洲研究部 2012年1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, FRM
研究分析師
leung.hoikit@ftse.com
+852 2164 3224

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

三菱集團(8058)、三菱日聯金融集團(8306)及東芝(6502)將於本次調整中分別各佔富時價值股份日本指數雙向變動權重之 5.00%

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1月調整後，三菱集團(8058)、三菱日聯金融集團(8306)及東芝(6502)等16家公司將納入富時價值股份日本指數，同時剔除包括東海旅客鐵道(9022)、住友商事(8053)及武田藥品(4502)在內的16隻指數成份股，以上變動將於2012年1月23日生效。本次指數之雙向變動權重預計為92.77%。

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	9432	日本電信電話	固定線路電信服務	5.84	5.00	-0.84	0.84
2	9437	NTT Docomo	移動電信服務	5.62	5.00	-0.62	0.62
3	8316	三井住友金融集團	銀行	5.27	5.00	-0.27	0.27
4	8309	三井住友信託控股	銀行	5.24	5.00	-0.24	0.24
5	9433	KDDI	移動電信服務	5.07	5.00	-0.07	0.07
6	8058	三菱集團	工業供應商	-	5.00	5.00	5.00
7	8306	三菱日聯金融集團	銀行	-	5.00	5.00	5.00
8	6502	東芝	綜合工業	-	5.00	5.00	5.00
9	8267	永旺集團	綜合零售商	-	3.85	3.85	3.85
10	5713	住友金屬礦山	有色金屬	3.33	3.79	0.46	0.46
11	5201	旭硝子玻璃	建築材料和設備	3.19	3.62	0.44	0.44
12	1878	大東建託	大型建築	3.05	3.46	0.42	0.42
13	3407	旭化成	一般化工製品	2.82	3.20	0.39	0.39
14	5802	住友電氣工業	汽車零件	-	3.15	3.15	3.15
15	4188	三菱化學	特殊化工用品	-	3.05	3.05	3.05
16	3405	可樂麗	一般化工製品	2.38	2.71	0.33	0.33
17	8332	橫濱銀行	銀行	2.09	2.38	0.29	0.29
18	6988	日東電工	特殊化工用品	2.04	2.32	0.28	0.28
19	1928	積水建邦	住宅建築	-	2.27	2.27	2.27
20	8331	千葉銀行	銀行	-	2.11	2.11	2.11
21	7259	愛信精機	汽車零件	-	2.11	2.11	2.11
22	7270	富士重工業	汽車	1.63	1.85	0.22	0.22
23	4307	野村綜合研究所	計算機服務	1.62	1.84	0.22	0.22
24	5214	日本電氣硝子	電器元件和設備	-	1.79	1.79	1.79
25	8354	福岡金融集團	銀行	1.55	1.76	0.21	0.21
26	6448	日本兄弟工業	辦公自動化設備	1.51	1.72	0.21	0.21
27	6586	牧田公司	耐用家庭用品	-	1.71	1.71	1.71
28	4204	積水化學工業	住宅建築	-	1.68	1.68	1.68
29	6473	捷太格特	汽車零件	-	1.67	1.67	1.67
30	7262	大發工業	汽車	-	1.57	1.57	1.57
31	5711	三菱材料公司	綜合工業	1.22	1.38	0.17	0.17
32	6302	住友重機械工業	工業機械	1.19	1.36	0.16	0.16
33	6471	NSK	汽車零件	-	1.35	1.35	1.35
34	6417	三共	博彩	-	1.15	1.15	1.15
35	4183	三井化學	一般化工製品	1.01	1.15	0.14	0.14
-	9022	東海旅客鐵道	旅遊和觀光	5.70	-	-5.70	5.70

註：1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2012年1月13日

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 (%)
-	8053	住友商事	工業供應商	5.55	-	-5.55	5.55
-	4502	武田藥品	製藥	4.96	-	-4.96	4.96
-	8766	東京海上控股	財產及人身保險	4.38	-	-4.38	4.38
-	7741	Hoya	電子設備	4.02	-	-4.02	4.02
-	8002	日本丸紅	工業供應商	3.57	-	-3.57	3.57
-	8035	東京電子	半導體	3.13	-	-3.13	3.13
-	1925	大和房屋工業	住宅建築	2.36	-	-2.36	2.36
-	4005	住友化學工業	一般化工製品	2.00	-	-2.00	2.00
-	6762	東京電氣化學	電器元件和設備	1.82	-	-1.82	1.82
-	3861	王子製紙	造紙	1.75	-	-1.75	1.75
-	4507	鹽野義製藥	製藥	1.42	-	-1.42	1.42
-	7013	石川島播磨重工業	綜合工業	1.18	-	-1.18	1.18
-	3401	帝人	一般化工製品	0.95	-	-0.95	0.95
-	4182	三菱瓦斯化學	一般化工製品	0.85	-	-0.85	0.85
-	5202	日本板硝子	建築材料和設備	0.70	-	-0.70	0.70
		合計	-	100.00	100.00	-	92.77

東海旅客鐵道(9022)、住友商事(8053)及武田藥品(4502)於富時價值股份日本指數調整前之權重分別為5.70%、5.55%及4.96%

註：1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2012年1月13日

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	6	-3	17.13	16.21	-0.91	10.19
化工製品	5	-2	12.05	12.42	0.38	7.99
林業和造紙	0	-1	1.75	0.00	-1.75	1.75
工業金屬和礦業	1	0	3.33	3.79	0.46	0.46
工業	7	-3	25.48	21.62	-3.87	29.82
建築和材料	2	-1	6.93	7.09	0.15	1.56
一般工業	2	0	2.40	6.38	3.98	6.35
電子和電器設備	1	-1	5.83	1.79	-4.04	7.62
工業工程	1	0	1.19	1.36	0.16	0.16
輔助服務	1	-1	9.12	5.00	-4.12	14.12
生活消費品	9	7	3.99	17.36	13.37	18.09
汽車和零件	6	5	1.63	11.71	10.08	10.08
家庭用品及住宅建築	3	2	2.36	5.65	3.29	8.01
衛生保健	0	-2	6.38	0.00	-6.38	6.38
製藥和生物科技	0	-2	6.38	0.00	-6.38	6.38
消費服務	2	1	5.70	5.00	-0.70	10.70
一般零售商	1	1	0.00	3.85	3.85	3.85
旅遊和休閒	1	0	5.70	1.15	-4.54	6.85
電信服務	3	0	16.53	15.00	-1.53	1.53
固定線路電信服務	1	0	5.84	5.00	-0.84	0.84
移動電信服務	2	0	10.69	10.00	-0.69	0.69
金融	6	1	18.54	21.25	2.71	12.51
銀行	6	2	14.16	21.25	7.10	8.12
非人壽保險	0	-1	4.38	0.00	-4.38	4.38
科技	2	-1	6.26	3.55	-2.70	3.56
軟件和計算機服務	1	0	1.62	1.84	0.22	0.22
科技硬件和設備	1	-1	4.64	1.72	-2.92	3.34
合計	35	32	100.00	100.00	-	92.77

資料來源：富時集團，截至2012年1月13日

汽車和零件將有最大的行業權重變化，增長 10.08% 至 11.71%

製藥和生物科技將有最大的行業權重跌幅，下降 6.38%

富時價值股份指數

富時價值股份日本指數定期調整分析 - 2012 年 1 月

免責聲明

© 2012 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。