

富时亚洲研究部 2012年1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, FRM
研究分析师
leung.hoikit@ftse.com
+852 2164 3224

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

三菱集团 (8058)、三菱日联金融集团 (8306) 及东芝 (6502) 将于本次调整中分别各占富时价值股份日本指数双向变动权重之 5.00%

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1月调整后, 三菱集团 (8058)、三菱日联金融集团 (8306) 及东芝 (6502) 等16家公司将纳入富时价值股份日本指数, 同时剔除包括东海旅客铁道 (9022)、住友商事 (8053) 及武田药品 (4502) 在内的16隻指数成份股, 以上变动将于2012年1月23日生效。本次指数之双向变动权重预计为92.77%。

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	9432	日本电信电话	固定线路电信服务	5.84	5.00	-0.84	0.84
2	9437	NTT Docomo	移动通信服务	5.62	5.00	-0.62	0.62
3	8316	三井住友金融集团	银行	5.27	5.00	-0.27	0.27
4	8309	三井住友信託控股	银行	5.24	5.00	-0.24	0.24
5	9433	KDDI	移动通信服务	5.07	5.00	-0.07	0.07
6	8058	三菱集团	工业供应商	-	5.00	5.00	5.00
7	8306	三菱日联金融集团	银行	-	5.00	5.00	5.00
8	6502	东芝	综合工业	-	5.00	5.00	5.00
9	8267	永旺集团	综合零售商	-	3.85	3.85	3.85
10	5713	住友金属矿山	有色金属	3.33	3.79	0.46	0.46
11	5201	旭硝子玻璃	建筑材料和设备	3.19	3.62	0.44	0.44
12	1878	大东建托	大型建筑	3.05	3.46	0.42	0.42
13	3407	旭化成	一般化工制品	2.82	3.20	0.39	0.39
14	5802	住友电气工业	汽车零件	-	3.15	3.15	3.15
15	4188	三菱化学	特殊化工用品	-	3.05	3.05	3.05
16	3405	可乐丽	一般化工制品	2.38	2.71	0.33	0.33
17	8332	横滨银行	银行	2.09	2.38	0.29	0.29
18	6988	日东电工	特殊化工用品	2.04	2.32	0.28	0.28
19	1928	积水建房	住宅建筑	-	2.27	2.27	2.27
20	8331	千叶银行	银行	-	2.11	2.11	2.11
21	7259	爱信精机	汽车零件	-	2.11	2.11	2.11
22	7270	富士重工业	汽车	1.63	1.85	0.22	0.22
23	4307	野村综合研究所	计算机服务	1.62	1.84	0.22	0.22
24	5214	日本电气硝子	电器元件和设备	-	1.79	1.79	1.79
25	8354	福冈金融集团	银行	1.55	1.76	0.21	0.21
26	6448	日本兄弟工业	办公自动化设备	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	积水化学工业	住宅建筑	-	1.68	1.68	1.68
29	6473	捷太格特	汽车零件	-	1.67	1.67	1.67
30	7262	大发工业	汽车	-	1.57	1.57	1.57
31	5711	三菱材料公司	综合工业	1.22	1.38	0.17	0.17
32	6302	住友重机械工业	工业机械	1.19	1.36	0.16	0.16
33	6471	NSK	汽车零件	-	1.35	1.35	1.35
34	6417	三共	博彩	-	1.15	1.15	1.15
35	4183	三井化学	一般化工制品	1.01	1.15	0.14	0.14
-	9022	东海旅客铁道	旅游和观光	5.70	-	-5.70	5.70

注: 1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2012年1月13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 (%)
-	8053	住友商事	工业供应商	5.55	-	-5.55	5.55
-	4502	武田药品	制药	4.96	-	-4.96	4.96
-	8766	东京海上控股	财产及人身保险	4.38	-	-4.38	4.38
-	7741	Hoya	电子设备	4.02	-	-4.02	4.02
-	8002	日本丸红	工业供应商	3.57	-	-3.57	3.57
-	8035	东京电子	半导体	3.13	-	-3.13	3.13
-	1925	大和房屋工业	住宅建筑	2.36	-	-2.36	2.36
-	4005	住友化学工业	一般化工制品	2.00	-	-2.00	2.00
-	6762	东京电气化学	电器元件和设备	1.82	-	-1.82	1.82
-	3861	王子制纸	造纸	1.75	-	-1.75	1.75
-	4507	盐野义制药	制药	1.42	-	-1.42	1.42
-	7013	石川岛播磨重工业	综合工业	1.18	-	-1.18	1.18
-	3401	帝人	一般化工制品	0.95	-	-0.95	0.95
-	4182	三菱瓦斯化学	一般化工制品	0.85	-	-0.85	0.85
-	5202	日本板硝子	建筑材料和设备	0.70	-	-0.70	0.70
		合计	-	100.00	100.00	-	92.77

东海旅客铁道(9022)、住友商事(8053)及武田药品(4502)于富时价值股份日本指数调整前之权重分别为5.70%、5.55%及4.96%

注：1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2012年1月13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	6	-3	17.13	16.21	-0.91	10.19
化工制品	5	-2	12.05	12.42	0.38	7.99
林业和造纸	0	-1	1.75	0.00	-1.75	1.75
工业金属和矿业	1	0	3.33	3.79	0.46	0.46
工业	7	-3	25.48	21.62	-3.87	29.82
建筑和材料	2	-1	6.93	7.09	0.15	1.56
一般工业	2	0	2.40	6.38	3.98	6.35
电子和电器设备	1	-1	5.83	1.79	-4.04	7.62
工业工程	1	0	1.19	1.36	0.16	0.16
辅助服务	1	-1	9.12	5.00	-4.12	14.12
生活消费品	9	7	3.99	17.36	13.37	18.09
汽车和零件	6	5	1.63	11.71	10.08	10.08
家庭用品及住宅建筑	3	2	2.36	5.65	3.29	8.01
卫生保健	0	-2	6.38	0.00	-6.38	6.38
制药和生物科技	0	-2	6.38	0.00	-6.38	6.38
消费服务	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
旅游和休闲	1	0	5.70	1.15	-4.54	6.85
电信服务	3	0	16.53	15.00	-1.53	1.53
固定线路电信服务	1	0	5.84	5.00	-0.84	0.84
移动电信服务	2	0	10.69	10.00	-0.69	0.69
金融	6	1	18.54	21.25	2.71	12.51
银行	6	2	14.16	21.25	7.10	8.12
非人寿保险	0	-1	4.38	0.00	-4.38	4.38
科技	2	-1	6.26	3.55	-2.70	3.56
软件和计算机服务	1	0	1.62	1.84	0.22	0.22
科技硬件和设备	1	-1	4.64	1.72	-2.92	3.34
合计	35	32	100.00	100.00	-	92.77

汽车和零件将有最大的行业权重变化，增长 10.08% 至 11.71%

制药和生物科技将有最大的行业权重跌幅，下降 6.38%

资料来源：富时集团，截至2012年1月13日

富时价值股份指数

富时价值股份日本指数定期调整分析 - 2012 年 1 月

免责声明

© 2012 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。