

# 富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數

富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數專門為認同伊斯蘭教義的投資者而設，用於構建針對伊斯蘭市場開發結構性的投資產品，成份股包括於臺灣證券交易所上市而符合伊斯蘭教義的公司。

指數以「富時全球股票指數系列」(FTSE Global Equity Index Series) 大型與中型市值成份股中，於臺灣證券交易所上市之股票為根據，挑選符合伊斯蘭教義之股票作為成份股。成份股由市場領先的Yasaar Ltd. 根據一系列高透明度及清晰的伊斯蘭教義作為篩選標準，指數可作為投資於臺灣市場中符合伊斯蘭教義的指標。

## 富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數的篩選過程

首先，所有符合以下活動的公司會被剔除作為伊斯蘭成份股的資格：

- 傳統非伊斯蘭金融行業 (非伊斯蘭教銀行、金融及保險等)
- 酒類行業
- 有關豬肉產品，不按伊斯蘭教規宰殺牲畜及製作，包括包裝和製作過程有關任何違反伊斯蘭教規的公司
- 娛樂，包括賭場、投機性及色情行業
- 煙草行業
- 武器、防禦武器生產

餘下的公司會進行財務篩選，符合伊斯蘭教法標準的公司必須通過以下財政比率：

- 債務總值少於總資產的33%
- 現金及利息比率少於總資產的33%
- 現金及應收賬目少於總資產值的50%
- 總利率收入和不符合伊斯蘭教規標準的收入不能多於總利息的5%

篩選過程未能盡錄，以上是繁複的篩選規則中的基本準則，詳情請參考ftse.com/taiwan中的指數編制規則

## 特點

- 與公正馳名的伊斯蘭諮詢公司，Yassar Ltd.合作，富時能繼續保持中立及提供最新資訊
- Yasaar研究學者代表主要伊斯蘭學派，根據各地不同的標準為各地的伊斯蘭投資者作出適當的建議
- 提供股價及報酬指數
- 成份股經過自由流通量加權以確保指數的可投資性
- 成份股經過流動性篩選以確保指數的可交易性
- 指數採用全球公認的行業分類系統 – 行業分類基準 (ICB) 計算
- 指數可用於建構多種衍生產品、指數基金、ETF及作為市場基準
- 指數會作定期審核，以確保指數能準確地反映市場表現
- 詳細資料，請查詢以下網址：  
[www.yasaar.org](http://www.yasaar.org)

## 富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數5年表現 (以台幣計算之總回報)



資料來源：富時集團，截至2010年11月30日

## 富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數表現及波幅列表 (以台幣計算之總回報)

	表現								波幅		
	3M (%)	6M (%)	YTD (%)	12M (%)	3YR (%)	5YR (%)	3YR (%pa)	5YR (%pa)	1YR Vol (%pa)*	3YR Vol (%pa)**	5YR Vol (%pa)**
富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數	10.1	15.2	3.0	10.4	4.3	48.3	1.4	8.2	16.5	27.8	23.7
富時臺灣指數	10.3	17.3	4.8	12.7	2.5	42.8	0.8	7.4	17.3	28.9	24.4

\* 以每天年化總回報計算之歷史波幅 (全年交易日數以260天計算)

\*\* 以每月年化總回報計算之歷史波幅

資料來源：富時集團，截至2010年11月30日

## 富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數十大成份股

排名	成份股	ICB 超行業	可投資市值 (百萬台幣)	權重 (%)
1	台灣積體電路	科技	1,632,767	20.42
2	鴻海科技	工業用品和服務	1,036,179	12.96
3	台灣塑膠工業	化工製品	555,160	6.94
4	南亞塑膠	化工製品	533,171	6.67
5	台灣化學纖維	化工製品	385,387	4.82
6	中華電信	電信服務	351,606	4.40
7	中國鋼鐵	基礎資源	318,118	3.98
8	友達光電	科技	267,206	3.34
9	聯華電子	科技	196,115	2.45
10	廣達電腦	科技	172,178	2.15
	<b>總和</b>		<b>5,447,887</b>	<b>68.14</b>

資料來源：富時集團，截至2010年11月30日

## 富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數ICB超行業分析

ICB 編碼	ICB 超行業	成份股數量	可投資市值 (百萬台幣)	權重 (%)
9500	科技	23	3,293,723	41.20
2700	工業用品和服務	14	1,625,881	20.34
1300	化工製品	6	1,598,404	19.99
6500	電信服務	3	547,468	6.85
1700	基礎資源	2	347,894	4.35
3700	個人和家庭用品	6	347,819	4.35
3300	汽車和零件	3	156,477	1.96
2300	建築和材料	1	55,159	0.69
8600	房地產	1	21,742	0.27
	<b>總和</b>	<b>59</b>	<b>7,994,566</b>	<b>100.00</b>

資料來源：富時集團，截至2010年11月30日

## 富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數組合特徵

	富時臺灣證券交易所臺灣伊斯蘭指數	富時臺灣指數
成份股數量	59	110
可投資市值 (百萬台幣)	7,994,566	13,306,708
<b>成份股市值 (可投資市值 (百萬台幣))</b>		
平均	135,501	120,970
最大	1,632,767	1,632,767
最小	6,053	6,053
中位數	40,406	50,893
最大成份股權重 (%)	20.42	12.27
十大成份股 (% 指數市值)	68.14	47.19

資料來源：富時集團，截至2010年11月30日

## 指數信息

### 合資格證券

富時全球股票指數系列 (GEIS)

### 指數發佈日

2008年11月13日

### 基期

2003年9月22日

### 基點

5000

### 可投資篩選

自由流通量調整及流動性篩選

### 指數計算

提供即時及收盤指數

即時指數每十五秒計算

### 收盤值發佈時間

收盤值於當地時間17:30 (格林威治時間9:30或英國夏令時間10:30) 通過FTP及電郵發佈

### 貨幣

台幣 (TWD) 及美元 (USD)

即時指數只以台幣計算

### 審核時間

年度審核: 3月、6月、9月、12月

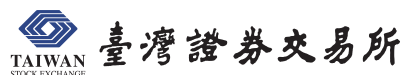
### 編制規則

[www.ftse.com/taiwan](http://www.ftse.com/taiwan)

### 指數代碼

[www.ftse.com/taiwan](http://www.ftse.com/taiwan)

©FTSE International Limited ("FTSE") and Taiwan Stock Exchange Corporation ("TWSE") 2011. All rights reserved. All rights in the FTSE TWSE Taiwan Index Series, a FTSE/TWSE product, vest in TWSE and FTSE. "TWSE" is a trademark of TWSE and is used by FTSE under licence. "FTSE®" is a trade mark of the London Stock Exchange Plc and The Financial Times Limited and is used by FTSE under licence. Industry Classification Benchmark ("ICB") is a product of FTSE. All intellectual property rights in and to ICB vest in FTSE and a licence from FTSE is required for use of ICB. FTSE and its licensors do not accept any liability to any person for any loss or damage arising out of any error or omission in ICB. No part of this publication may be reproduced, stored in a retrieval system or transmitted in any form or by any means without prior written consent of FTSE and TWSE. Neither TWSE nor FTSE shall be liable (including in negligence) for any loss arising out of reliance on, or use of, the FTSE TWSE Taiwan Index Series, a FTSE/TWSE product, or the contents of this publication by any person.



FOR FURTHER INFORMATION VISIT [WWW.FTSE.COM](http://WWW.FTSE.COM), EMAIL [INFO@FTSE.COM](mailto: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 72426 641 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 1800 653 680 TAIWAN 0080 185 6152 THAILAND 001 800 852 5111 TOKYO +81 3 3581 2811

