

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

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

兴业银行(A股)(601166)、山西西山煤电(A股)(000983)及阳泉煤业(A股)(600348)将于本次调整中占富时价值股份中国A股指数双向变动权重之 8.50%、2.60%及2.40%

调整概述

富时价值股份中国A股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只于上海证券交易所和深圳证券交易所上市且交投活跃和流通性高的优质价值型中国A股。

富时价值股份中国A股指数于9月调整后, 兴业银行(A股)(601166)、山西西山煤电(A股)(000983)及阳泉煤业(A股)(600348)等19家公司将纳入富时价值股份中国A股指数, 同时剔除包括中国建筑(A股)(601668)、紫金矿业(A股)(601899)及广汇实业(A股)(600256)在内的19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64.76%。

主要变动概述如下:

表一: 富时价值股份中国A股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	600000	上海浦东发展银行(A股)	银行	9.47	10.00	0.53	0.53
2	601328	交通银行(A股)	银行	9.72	9.12	-0.60	0.60
3	601166	兴业银行(A股)	银行	-	8.50	8.50	8.50
4	601398	中国工商银行(A股)	银行	5.56	5.22	-0.34	0.34
5	600837	海通证券(A股)	投资服务	4.16	3.90	-0.26	0.26
6	601169	北京银行(A股)	银行	3.87	3.63	-0.24	0.24
7	601939	中国建设银行(A股)	银行	3.72	3.49	-0.23	0.23
8	601857	中国石油(A股)	综合性石油和天然气	3.36	3.15	-0.21	0.21
9	000983	山西西山煤电(A股)	煤炭	-	2.60	2.60	2.60
10	600348	阳泉煤业(A股)	煤炭	-	2.40	2.40	2.40
11	600015	华夏银行(A股)	银行	2.44	2.29	-0.15	0.15
12	600019	宝山钢铁(A股)	铁和钢铁	-	2.16	2.16	2.16
13	000776	广发证券(A股)	投资服务	2.29	2.15	-0.14	0.14
14	601818	中国光大银行(A股)	银行	-	1.97	1.97	1.97
15	601628	中国人寿(A股)	人寿保险	1.96	1.83	-0.12	0.12
16	601988	中国银行(A股)	银行	1.95	1.83	-0.12	0.12
17	600739	辽宁成大(A股)	专项零售商	-	1.69	1.69	1.69
18	002142	宁波银行(A股)	银行	1.79	1.68	-0.11	0.11
19	601009	南京银行(A股)	银行	1.58	1.48	-0.10	0.10
20	601898	中国中煤能源(A股)	煤炭	1.47	1.38	-0.09	0.09
21	601688	华泰证券(A股)	投资服务	-	1.36	1.36	1.36
22	000937	冀中能源(A股)	煤炭	1.42	1.33	-0.09	0.09
23	600177	雅戈尔(A股)	服装和饰品	1.41	1.32	-0.09	0.09
24	600999	招商证券(A股)	投资服务	-	1.32	1.32	1.32
25	600875	东方电气(A股)	工业机械	1.32	1.24	-0.08	0.08
26	000402	金融街(A股)	房地产及其开发	1.29	1.21	-0.08	0.08
27	601919	中国远洋控股(A股)	海上运输	-	1.20	1.20	1.20
28	002422	四川科伦药业(A股)	制药	-	1.20	1.20	1.20
29	000039	中集集团(A股)	容器和包装	1.27	1.19	-0.08	0.08
30	000528	柳工机械(A股)	商业用车和货车	1.25	1.17	-0.08	0.08
31	600741	华宇汽车系统(A股)	汽车零件	-	1.00	1.00	1.00
32	002202	新疆金风科技(A股)	可再生能源设备	-	0.96	0.96	0.96
33	601788	光大证券(A股)	投资服务	1.02	0.95	-0.06	0.06
34	600655	豫园商城(A股)	服装零售商	1.00	0.94	-0.06	0.06
35	601666	平煤股份(A股)	煤炭	0.99	0.93	-0.06	0.06
36	600664	哈药股份(A股)	制药	0.98	0.92	-0.06	0.06

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：富时价值股份中国A股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	600150	中国船舶 (A股)	商业用车和货车	0.97	0.91	-0.06	0.06
38	000839	中信国安资讯产业 (A股)	电信设备	-	0.90	0.90	0.90
39	600208	新湖中宝 (A股)	房地产及其开发	-	0.88	0.88	0.88
40	601001	大同煤业 (A股)	煤炭	0.89	0.84	-0.06	0.06
41	600895	张江高科 (A股)	房地产及其开发	0.88	0.83	-0.05	0.05
42	600642	申能股份 (A股)	传统电力	-	0.83	0.83	0.83
43	600160	浙江巨化 (A股)	特殊化工用品	0.88	0.83	-0.05	0.05
44	000783	长江证券 (A股)	投资服务	0.87	0.82	-0.05	0.05
45	600216	浙江医药 (A股)	制药	0.84	0.79	-0.05	0.05
46	600832	东方明珠 (A股)	休闲服务	0.82	0.77	-0.05	0.05
47	600600	青岛啤酒 (A股)	酿造商	-	0.76	0.76	0.76
48	000800	一汽轿车 (A股)	汽车	-	0.76	0.76	0.76
49	000939	武汉凯迪电力 (A股)	传统电力	-	0.71	0.71	0.71
50	600997	开滦能源化工 (A股)	煤炭	-	0.64	0.64	0.64
-	601668	中国建筑 (A股)	大型建筑	3.53	-	-3.53	3.53
-	601899	紫金矿业 (A股)	金矿开采	3.50	-	-3.50	3.50
-	600256	广汇实业 (A股)	房地产及其开发	2.89	-	-2.89	2.89
-	601168	西部矿业 (A股)	有色金属	1.99	-	-1.99	1.99
-	601998	中信银行 (A股)	银行	1.87	-	-1.87	1.87
-	600690	青岛海尔 (A股)	耐用家庭用品	1.76	-	-1.76	1.76
-	600497	驰宏锌锗 (A股)	有色金属	1.63	-	-1.63	1.63
-	600143	金发科技 (A股)	特殊化工用品	1.36	-	-1.36	1.36
-	000623	吉林敖东 (A股)	制药	1.23	-	-1.23	1.23
-	600271	航天信息 (A股)	电子设备	1.15	-	-1.15	1.15
-	002155	辰州矿业 (A股)	金矿开采	1.10	-	-1.10	1.10
-	600970	中材国际 (A股)	工业机械	1.02	-	-1.02	1.02
-	600219	南山铝业 (A股)	铝业	0.99	-	-0.99	0.99
-	600315	上海家化 (A股)	个人用品	0.93	-	-0.93	0.93
-	600085	同仁堂 (A股)	制药	0.85	-	-0.85	0.85
-	600395	盘江精煤 (A股)	煤炭	0.81	-	-0.81	0.81
-	601808	中海油田服务 (A股)	产油设备和相关服务	0.68	-	-0.68	0.68
-	600649	城投控股 (A股)	房地产及其开发	0.67	-	-0.67	0.67
-	002008	大族激光 (A股)	电子设备	0.62	-	-0.62	0.62
		合计	-	100.00	100.00	-	64.76

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：富时价值股份中国A股指数行业分析

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	4.04	4.11	0.08	1.85
石油和天然气生产商	1	0	3.36	3.15	-0.21	0.21
产油设备、相关服务和分销	0	-1	0.68	0.00	-0.68	0.68
替代能源	1	1	0.00	0.96	0.96	0.96
基础材料	9	-3	17.03	13.11	-3.92	19.52
化工制品	1	-1	2.24	0.83	-1.41	1.41
工业金属和矿业	1	-2	4.61	2.16	-2.45	6.77
采矿	7	0	10.18	10.12	-0.06	11.34
工业	5	-3	11.12	5.71	-5.41	7.82
建筑和材料	0	-1	3.53	0.00	-3.53	3.53
一般工业	1	0	1.27	1.19	-0.08	0.08
电子和电气设备	0	-2	1.77	0.00	-1.77	1.77
工业工程	3	-1	4.55	3.32	-1.23	1.23
运输	1	1	0.00	1.20	1.20	1.20

资料来源：富时集团，截至2011年9月9日

中国建筑 (A股) (601668)、紫金矿业 (A股) (601899) 及广汇实业 (A股) (600256) 于富时价值股份中国A股指数调整前之权重分别为3.53%、3.50%及2.89%

银行将有最大的行业权重变化，增长7.25%至49.21%

续表二：富时价值股份中国A股指数行业分析

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 (%)
生活消费品	4	1	4.10	3.84	-0.26	5.29
汽车和零件	2	2	0.00	1.76	1.76	1.76
饮料	1	1	0.00	0.76	0.76	0.76
家庭用品及住宅建筑	0	-1	1.76	0.00	-1.76	1.76
个人消费品	1	-1	2.34	1.32	-1.02	1.02
卫生保健	3	-1	3.89	2.91	-0.99	3.39
制药和生物科技	3	-1	3.89	2.91	-0.99	3.39
消费服务	3	1	1.82	3.40	1.57	1.80
一般零售商	2	1	1.00	2.62	1.62	1.75
旅游和休闲	1	0	0.82	0.77	-0.05	0.05
公用事业	2	2	0.00	1.54	1.54	1.54
电力	2	2	0.00	1.54	1.54	1.54
金融	21	2	57.99	64.47	6.48	22.65
银行	11	1	41.97	49.21	7.25	14.76
人寿保险	1	0	1.96	1.83	-0.12	0.12
房地产投资与服务	3	-1	5.73	2.92	-2.81	4.58
金融服务	6	2	8.34	10.50	2.16	3.19
科技	1	1	0.00	0.90	0.90	0.90
科技硬件和设备	1	1	0.00	0.90	0.90	0.90
合计	50	38	100.00	100.00	-	64.76

建筑和材料将有最大的行业权重跌幅，下降3.53%

资料来源：富时集团，截至2011年9月9日

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。