

富時亞洲研究部 2011年5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

梁凱傑
研究員
leung.hoikit@ftse.com
+852 2164 3224

吳廣熹
研究員
eddie.ngkwonghei@ftse.com
+852 2164 3225

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

台塑(1301)、南亞(1303)及富邦金(2881)將於本次調整中佔富時價值股份台灣指數雙向變動權重之10.00%、10.00%及4.85%

調整概述

富時價值股份台灣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50隻於臺灣證券交易所及證券櫃檯買賣中心上市且交投活躍和流通性高的優質價值型台灣股票。

富時價值股份台灣指數於5月調整後, 台塑(1301)、南亞(1303)及富邦金(2881)等22家公司將納入富時價值股份台灣指數, 同時剔除包括鴻海(2317)、聯發科(2454)及廣達(2382)在內的22隻指數成份股, 以上變動將於2011年5月23日生效。本次指數之雙向變動權重預計為92.47%。

主要變動概述如下:

表一: 富時價值股份台灣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	2330	台積電	半導體	11.69	10.00	-1.69	1.69
2	1301	台塑	一般化工製品	-	10.00	10.00	10.00
3	1303	南亞	一般化工製品	-	10.00	10.00	10.00
4	1326	台化	一般化工製品	9.42	8.29	-1.13	1.13
5	2002	中鋼	鐵和鋼鐵	7.29	6.42	-0.87	0.87
6	2881	富邦金	人壽保險	-	4.85	4.85	4.85
7	2891	中信金	銀行	-	4.49	4.49	4.49
8	2303	聯電	半導體	3.97	3.49	-0.47	0.47
9	2357	華碩	計算機硬件	3.36	2.96	-0.40	0.40
10	2885	元大金	投資服務	-	2.89	2.89	2.89
11	2311	日月光	半導體	3.17	2.79	-0.38	0.38
12	2324	仁寶	計算機硬件	2.95	2.60	-0.35	0.35
13	2353	宏碁	計算機硬件	2.91	2.56	-0.35	0.35
14	5854	合庫	銀行	-	1.97	1.97	1.97
15	3231	緯創	計算機硬件	2.00	1.76	-0.24	0.24
16	2890	永豐金	銀行	-	1.72	1.72	1.72
17	2105	正新	輪胎	-	1.47	1.47	1.47
18	9904	寶成	鞋類	1.61	1.42	-0.19	0.19
19	2448	晶電	電器元件和設備	-	1.40	1.40	1.40
20	3702	大聯大	半導體	1.55	1.37	-0.19	0.19
21	3037	欣興	電器元件和設備	-	1.37	1.37	1.37
22	6239	力成	半導體	1.49	1.31	-0.18	0.18
23	2337	旺宏	半導體	1.27	1.12	-0.15	0.15
24	2103	台橡	一般化工製品	1.06	0.94	-0.13	0.13
25	3034	聯詠	半導體	0.84	0.74	-0.10	0.10
26	1504	東元	耐用家庭用品	-	0.70	0.70	0.70
27	5483	中美晶	半導體	-	0.68	0.68	0.68
28	2395	研華	計算機硬件	-	0.65	0.65	0.65
29	2385	群光	計算機硬件	0.72	0.63	-0.09	0.09
30	2327	國巨	電器元件和設備	-	0.62	0.62	0.62
31	2393	億光	電器元件和設備	0.69	0.61	-0.08	0.08
32	6286	立錡	半導體	0.64	0.56	-0.08	0.08
33	8299	群聯電子	計算機硬件	0.63	0.55	-0.08	0.08
34	2379	瑞昱	半導體	0.62	0.55	-0.07	0.07
35	6244	茂迪	可再生能源設備	-	0.54	0.54	0.54
36	9921	巨大	休閒產品	-	0.53	0.53	0.53

註: 5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2011年5月13日

續表一：富時價值股份台灣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 (%)
37	2606	裕民	海上運輸	0.54	0.48	-0.06	0.06
38	3189	景碩	半導體	-	0.46	0.46	0.46
39	2006	東鋼	鐵和鋼鐵	-	0.44	0.44	0.44
40	1717	長興	特殊化工用品	0.48	0.42	-0.06	0.06
41	2392	正崴	電子設備	-	0.42	0.42	0.42
42	1507	永大	工業機械	0.47	0.41	-0.06	0.06
43	5522	遠雄	房地產及其開發	0.43	0.38	-0.05	0.05
44	9939	宏全	容器和包裝	-	0.37	0.37	0.37
45	1319	東陽	汽車零件	0.41	0.36	-0.05	0.05
46	3622	洋華	電器元件和設備	0.40	0.35	-0.05	0.05
47	3519	綠能	可再生能源設備	-	0.35	0.35	0.35
48	2489	瑞軒	消費性電器用品	0.40	0.35	-0.05	0.05
49	2376	技嘉	半導體	0.39	0.34	-0.05	0.05
50	6153	嘉聯益	電器元件和設備	-	0.34	0.34	0.34
-	2317	鴻海	電器元件和設備	8.89	-	-8.89	8.89
-	2454	聯發科	半導體	6.94	-	-6.94	6.94
-	2382	廣達	計算機硬件	3.55	-	-3.55	3.55
-	3045	台灣大	移動電信服務	2.82	-	-2.82	2.82
-	2325	矽品	半導體	2.48	-	-2.48	2.48
-	2801	彰銀	銀行	1.86	-	-1.86	1.86
-	1102	亞泥	建築材料和設備	1.81	-	-1.81	1.81
-	2474	可成	工業機械	1.76	-	-1.76	1.76
-	2301	光寶科	電器元件和設備	1.66	-	-1.66	1.66
-	3044	健鼎	電器元件和設備	1.29	-	-1.29	1.29
-	2356	英業達	計算機硬件	0.91	-	-0.91	0.91
-	1434	福懋	服裝和飾品	0.79	-	-0.79	0.79
-	5371	中強光電	電子設備	0.66	-	-0.66	0.66
-	2548	華固	房地產及其開發	0.46	-	-0.46	0.46
-	9933	中鼎	大型建築	0.40	-	-0.40	0.40
-	2106	建大	輪胎	0.39	-	-0.39	0.39
-	9917	中保	商業輔助服務	0.39	-	-0.39	0.39
-	2451	創見	半導體	0.37	-	-0.37	0.37
-	2332	友訊	電信設備	0.34	-	-0.34	0.34
-	3042	晶技	電器元件和設備	0.34	-	-0.34	0.34
-	2374	佳能	辦公自動化設備	0.26	-	-0.26	0.26
-	3061	璨圓	半導體	0.24	-	-0.24	0.24
合計				100.00	100.00	-	92.47

鴻海 (2317)、聯發科 (2454) 及廣達 (2382) 於富時價值股份台灣指數調整前之權重分別為 8.89%、6.94% 及 3.55%

註：5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2011年5月13日

表二：富時價值股份台灣指數行業分析

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 (%)
石油和天然氣	2	2	0.00	0.89	0.89	0.89
替代能源	2	2	0.00	0.89	0.89	0.89
基礎材料	7	3	18.25	36.50	18.26	22.62
化工製品	5	2	10.96	29.65	18.69	21.31
工業金屬和礦業	2	1	7.29	6.85	-0.43	1.31
工業	10	-3	19.29	6.36	-12.93	21.95
建築和材料	0	-2	2.21	0.00	-2.21	2.21
一般工業	1	1	0.00	0.37	0.37	0.37
電子和電器設備	7	0	13.93	5.11	-8.82	17.10
工業工程	1	-1	2.23	0.41	-1.82	1.82
運輸	1	0	0.54	0.48	-0.06	0.06
輔助服務	0	-1	0.39	0.00	-0.39	0.39

資料來源：富時集團，截至2011年5月13日

化工製品將有最大的行業權重變化，增長 18.69% 至 29.65%

續表二：富時價值股份台灣指數行業分析

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 (%)
生活消費品	6	1	3.60	4.83	1.24	4.17
汽車和零件	2	0	0.80	1.84	1.04	1.91
家庭用品及住宅建築	1	1	0.00	0.70	0.70	0.70
休閒用品	2	1	0.40	0.88	0.48	0.58
個人消費品	1	-1	2.40	1.42	-0.98	0.98
電信服務	0	-1	2.82	0.00	-2.82	2.82
移動電信服務	0	-1	2.82	0.00	-2.82	2.82
金融	6	3	2.75	16.28	13.54	18.28
銀行	3	2	1.86	8.17	6.31	10.03
人壽保險	1	1	0.00	4.85	4.85	4.85
房地產投資與服務	1	-1	0.89	0.38	-0.51	0.51
金融服務	1	1	0.00	2.89	2.89	2.89
科技	19	-5	53.30	35.13	-18.17	21.74
科技硬件和設備	19	-5	53.30	35.13	-18.17	21.74
合計	50	44	100.00	100.00	-	92.47

資料來源：富時集團，截至2011年5月13日

科技硬件和設備將有最大的行業權重跌幅，下降18.17%至35.13%

免責聲明

© 2011 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)、富時價值股份中國 A 股指數 (FTSE Value-Stocks China A-Share 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) 由富時集團和道瓊斯公司共同所有。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，富時集團和道瓊斯公司不承擔任何責任。