

# 富时价值股份指数

## 富时价值股份台湾指数定期调整分析 - 2011年5月

### 富时亚洲研究部 2011年5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

梁凯杰  
研究员  
leung.hoikit@ftse.com  
+852 2164 3224

吴广熹  
研究员  
eddie.ngkwonghei@ftse.com  
+852 2164 3225

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

台塑(1301)、南亚(1303)及富邦金(2881)将于本次调整中占富时价值股份台湾指数双向变动权重之10.00%、10.00%及4.85%

### 调整概述

富时价值股份台湾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只于台湾证券交易所及证券柜台买卖中心上市且交投活跃和流通性高的优质价值型台湾股票。

富时价值股份台湾指数于5月调整后, 台塑(1301)、南亚(1303)及富邦金(2881)等22家公司将纳入富时价值股份台湾指数, 同时剔除包括鸿海(2317)、联发科(2454)及广达(2382)在内的22隻指数成份股, 以上变动将于2011年5月23日生效。本次指数之双向变动权重预计为92.47%。

主要变动概述如下:

表一: 富时价值股份台湾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	2330	台积电	半导体	11.69	10.00	-1.69	1.69
2	1301	台塑	一般化工制品	-	10.00	10.00	10.00
3	1303	南亚	一般化工制品	-	10.00	10.00	10.00
4	1326	台化	一般化工制品	9.42	8.29	-1.13	1.13
5	2002	中钢	铁和钢铁	7.29	6.42	-0.87	0.87
6	2881	富邦金	人寿保险	-	4.85	4.85	4.85
7	2891	中信金	银行	-	4.49	4.49	4.49
8	2303	联电	半导体	3.97	3.49	-0.47	0.47
9	2357	华硕	计算机硬件	3.36	2.96	-0.40	0.40
10	2885	元大金	投资服务	-	2.89	2.89	2.89
11	2311	日月光	半导体	3.17	2.79	-0.38	0.38
12	2324	仁宝	计算机硬件	2.95	2.60	-0.35	0.35
13	2353	宏碁	计算机硬件	2.91	2.56	-0.35	0.35
14	5854	合库	银行	-	1.97	1.97	1.97
15	3231	纬创	计算机硬件	2.00	1.76	-0.24	0.24
16	2890	永丰金	银行	-	1.72	1.72	1.72
17	2105	正新	轮胎	-	1.47	1.47	1.47
18	9904	宝成	鞋类	1.61	1.42	-0.19	0.19
19	2448	晶电	电器元件和设备	-	1.40	1.40	1.40
20	3702	大联大	半导体	1.55	1.37	-0.19	0.19
21	3037	欣兴	电器元件和设备	-	1.37	1.37	1.37
22	6239	力成	半导体	1.49	1.31	-0.18	0.18
23	2337	旺宏	半导体	1.27	1.12	-0.15	0.15
24	2103	台橡	一般化工制品	1.06	0.94	-0.13	0.13
25	3034	联咏	半导体	0.84	0.74	-0.10	0.10
26	1504	东元	耐用家庭用品	-	0.70	0.70	0.70
27	5483	中美晶	半导体	-	0.68	0.68	0.68
28	2395	研华	计算机硬件	-	0.65	0.65	0.65
29	2385	群光	计算机硬件	0.72	0.63	-0.09	0.09
30	2327	国巨	电器元件和设备	-	0.62	0.62	0.62
31	2393	亿光	电器元件和设备	0.69	0.61	-0.08	0.08
32	6286	立铸	半导体	0.64	0.56	-0.08	0.08
33	8299	群联电子	计算机硬件	0.63	0.55	-0.08	0.08
34	2379	瑞昱	半导体	0.62	0.55	-0.07	0.07
35	6244	茂迪	可再生能源设备	-	0.54	0.54	0.54
36	9921	巨大	休闲产品	-	0.53	0.53	0.53

注: 5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5月13日

续表一：富时价值股份台湾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	2606	裕民	海上运输	0.54	0.48	-0.06	0.06
38	3189	景硕	半导体	-	0.46	0.46	0.46
39	2006	东钢	铁和钢铁	-	0.44	0.44	0.44
40	1717	长兴	特殊化工用品	0.48	0.42	-0.06	0.06
41	2392	正崧	电子设备	-	0.42	0.42	0.42
42	1507	永大	工业机械	0.47	0.41	-0.06	0.06
43	5522	远雄	房地产及其开发	0.43	0.38	-0.05	0.05
44	9939	宏全	容器和包装	-	0.37	0.37	0.37
45	1319	东阳	汽车零件	0.41	0.36	-0.05	0.05
46	3622	洋华	电器元件和设备	0.40	0.35	-0.05	0.05
47	3519	绿能	可再生能源设备	-	0.35	0.35	0.35
48	2489	瑞轩	消费性电器用品	0.40	0.35	-0.05	0.05
49	2376	技嘉	半导体	0.39	0.34	-0.05	0.05
50	6153	嘉联益	电器元件和设备	-	0.34	0.34	0.34
-	2317	鸿海	电器元件和设备	8.89	-	-8.89	8.89
-	2454	联发科	半导体	6.94	-	-6.94	6.94
-	2382	广达	计算机硬件	3.55	-	-3.55	3.55
-	3045	台湾大	移动通信服务	2.82	-	-2.82	2.82
-	2325	矽品	半导体	2.48	-	-2.48	2.48
-	2801	彰银	银行	1.86	-	-1.86	1.86
-	1102	亚泥	建筑材料和设备	1.81	-	-1.81	1.81
-	2474	可成	工业机械	1.76	-	-1.76	1.76
-	2301	光宝科	电器元件和设备	1.66	-	-1.66	1.66
-	3044	健鼎	电器元件和设备	1.29	-	-1.29	1.29
-	2356	英业达	计算机硬件	0.91	-	-0.91	0.91
-	1434	福懋	服装和饰品	0.79	-	-0.79	0.79
-	5371	中强光电	电子设备	0.66	-	-0.66	0.66
-	2548	华固	房地产及其开发	0.46	-	-0.46	0.46
-	9933	中鼎	大型建筑	0.40	-	-0.40	0.40
-	2106	建大	轮胎	0.39	-	-0.39	0.39
-	9917	中保	商业辅助服务	0.39	-	-0.39	0.39
-	2451	创见	半导体	0.37	-	-0.37	0.37
-	2332	友讯	电信设备	0.34	-	-0.34	0.34
-	3042	晶技	电器元件和设备	0.34	-	-0.34	0.34
-	2374	佳能	办公自动化设备	0.26	-	-0.26	0.26
-	3061	璨圆	半导体	0.24	-	-0.24	0.24
合计				100.00	100.00	-	92.47

鸿海(2317)、联发科(2454)及广达(2382)于富时价值股份台湾指数调整前之权重分别为8.89%、6.94%及3.55%

注：5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5月13日

表二：富时价值股份台湾指数行业分析

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	2	0.00	0.89	0.89	0.89
替代能源	2	2	0.00	0.89	0.89	0.89
基础材料	7	3	18.25	36.50	18.26	22.62
化工制品	5	2	10.96	29.65	18.69	21.31
工业金属和矿业	2	1	7.29	6.85	-0.43	1.31
工业	10	-3	19.29	6.36	-12.93	21.95
建筑和材料	0	-2	2.21	0.00	-2.21	2.21
一般工业	1	1	0.00	0.37	0.37	0.37
电子和电器设备	7	0	13.93	5.11	-8.82	17.10
工业工程	1	-1	2.23	0.41	-1.82	1.82
运输	1	0	0.54	0.48	-0.06	0.06
辅助服务	0	-1	0.39	0.00	-0.39	0.39

化工制品将有最大的行业权重变化，增长18.69%至29.65%

资料来源：富时集团，截至2011年5月13日

续表二：富时价值股份台湾指数行业分析

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	6	1	3.60	4.83	1.24	4.17
汽车和零件	2	0	0.80	1.84	1.04	1.91
家庭用品及住宅建筑	1	1	0.00	0.70	0.70	0.70
休闲用品	2	1	0.40	0.88	0.48	0.58
个人消费品	1	-1	2.40	1.42	-0.98	0.98
电信服务	0	-1	2.82	0.00	-2.82	2.82
移动通信服务	0	-1	2.82	0.00	-2.82	2.82
金融	6	3	2.75	16.28	13.54	18.28
银行	3	2	1.86	8.17	6.31	10.03
人寿保险	1	1	0.00	4.85	4.85	4.85
房地产投资与服务	1	-1	0.89	0.38	-0.51	0.51
金融服务	1	1	0.00	2.89	2.89	2.89
科技	19	-5	53.30	35.13	-18.17	21.74
科技硬件和设备	19	-5	53.30	35.13	-18.17	21.74
合计	50	44	100.00	100.00	-	92.47

资料来源：富时集团，截至2011年5月13日

科技硬件和设备将有最大的行业权重跌幅，下降18.17%至35.13%

## 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)、富时价值股份中国 A 股指数 (FTSE Value-Stocks China A-Share 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) 由富时集团和道琼斯公司共同所有。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，富时集团和道琼斯公司不承担任何责任。