

富時臺灣證券交易所臺灣基本面指數系列

富時臺灣證券交易所臺灣基本面指數系列是根據基本面值加權的指數，旨在提供投資者一條有別於傳統的市值加權指數，以投資臺灣證券市場。

指數由富時臺灣證券交易所、富時集團及銳聯資產管理公司聯合推出，成份股依據上市公司的四個基本因素，包括現金股息總額、現金流量、銷售總額及股票賬面值進行加權。指數結合了在地的知識及國際性的指數專業技術，為在地及國際投資者提供一系列具代表性的指標。

富時臺灣證券交易所臺灣基本面指數系列包括：

- 富時臺灣證券交易所臺灣基本面50指數: 基本面數值前50大的臺灣上市公司
- 富時臺灣證券交易所臺灣基本面100指數: 富時臺灣證券交易所臺灣基本面50指數成份股外，基本面數值前100大的臺灣上市公司

富時臺灣證券交易所臺灣基本面50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基本面50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基本面50指數	12.1	21.2	8.7	16.0	10.9	50.3	3.5	8.5	16.8	26.9	22.5
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基本面100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

特點

- 結合主動管理及被動投資的雙重優勢；擁低交易成本、高透明度的投資選擇及高投資能力
- 根據基本面因素而非價錢去調整股票比重，當進行年度審核時，指數會減持某些價格跑贏大市的成份股，亦會增持某些價格跑輸大市的成份股
- 對於市盈率偏高的股票，基本因素加權不會在其市盈率無法持續擴張的時期增加該股票的比重，避免過度承擔於高估股票價值的風險
- 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
- 指數系列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

富時臺灣證券交易所臺灣基本面100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基本面100指數	11.8	20.0	9.1	21.0	11.8	68.0	3.8	10.9	20.2	35.9	30.4
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基本面50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	53,616	11.67
2	台灣塑膠工業	化工製品	18,230	8.02
3	鴻海科技	工業用品和服務	34,026	6.47
4	HTC	科技	22,549	5.11
5	中國鋼鐵	基礎資源	13,928	4.27
6	中華電信	電信服務	23,563	4.21
7	南亞塑膠	化工製品	17,508	3.93
8	台灣化學纖維	化工製品	16,874	3.53
9	友達光電	科技	8,774	3.33
10	兆豐金控	銀行	7,427	2.15
	總和		216,495	52.69

* 設富時基本面調整前之自由流通量市值

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基本面50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	16	160,424	38.45
1300	化工製品	3	52,612	15.48
2700	工業用品和服務	7	56,491	12.72
8300	銀行	8	34,275	10.97
6500	電信服務	3	36,689	6.08
1700	基礎資源	1	13,928	4.27
8500	保險	3	28,593	3.43
3700	個人和家庭用品	2	9,710	2.90
3500	食品和飲料	1	5,934	1.64
0500	石油和天然氣	1	26,291	1.31
2300	建築和材料	2	6,744	1.03
5300	零售	1	4,199	0.89
8700	金融服務	1	3,283	0.83
	總和	49	439,172	100.00

* 設富時基本面調整前之自由流通量市值

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基本面指數系列組合特徵

	富時臺灣證券交易所臺灣 基本面50指數	富時臺灣證券交易所臺灣 基本面100指數	富時臺灣指數
成份股數量	49	98	110
可投資市值 (百萬台幣)	439,172*	123,869*	13,306,708
成份股市值 (可投資市值 (百萬台幣))			
平均	8,963*	1,264*	120,970
最大	53,616*	4,962*	1,632,767
最小	1,327*	220*	6,053
中位數	5,537*	918*	50,893
最大成份股權重(%)	11.67	3.02	12.27
十大成份股 (% 指數市值)	52.69	24.44	47.19

* 設富時基本面調整前之自由流通量市值

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10月27日

基期

2008年3月26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

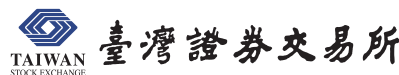
編制規則

www.ftse.com/taiwan

指數代碼

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, EMAIL 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

