

# 00940ETF換股預測

統一投顧

2024.05

# 00940換檔ETF-選股邏輯、換股時間、剔除邏輯、配息方式

更新至2024/5/6

股票代號	00940
股票名稱	元大台灣價值高息
20240506總市值(億)	1853.3
20240503殖利率(%)	
持股邏輯	排除創新板、KY後，選取發行市值前300大之股票。流動性檢驗(近1個月成交金額前70%中，近12個月成交金額前20%or至少8個月週轉率>3%或成交金額達1億元)，第一階段:近3年皆有發放股利；排除5月定審生效日前已除息之年配息股票；負債比率前90%低；ROE前90%高；益本比前80%高；近4季稅後淨利前90%高；近4季毛利率成長前90%高；投資及中度前95%低。如第一階段股票未達90檔則放寬標準直至達90檔，分別將自由現金流量收益率、股利率指標及益本比標準化後計算綜合分數，選取綜合分數排名前50名之股票(個股權重上限8%)。
殖利率計算	近一年現金殖利率
換股時間	每年2次進行成分股定期審核，以5、11月的第7個交易日為審核基準日，審核資料截至前一個月最後一個交易日。
剔除邏輯	排名在第35名以內之股票即納入成為指數成分股，既有成分股若排名在第65名之後則從指數成分股中剔除
配息方式	月配息

# 00940持股較為分散，其中半導體產業佔近三分之一

產業比重	00940
	元大臺灣價值高息
電子-半導體	30.22%
金融保險	3.90%
電子-電腦及週邊設備	15.57%
電子-電子零組件	7.06%
電子-通信網路	4.05%
塑膠工業	0.00%
食品工業	2.01%
鋼鐵工業	0.52%
電子-光電	0.75%
汽車工業	2.69%
航運業	9.51%
貿易百貨	0.00%
電機機械	2.09%
油電燃氣	0.00%
運動休閒	2.17%
水泥工業	0.00%
電器電纜	0.00%
紡織纖維	0.00%
橡膠工業	0.00%
建材營建	0.00%
電子-其他電子	8.05%
電子-電子通路	1.71%
文化創意	3.14%

# 00940選股預測

00940-持股特性深入分析

因篇幅僅放前30檔

最小值	市值	流動性(億)	ESG分數	10年均值利率	近年現金股利
假設門檻	267 前300大	0.0 按原條件	6 >=6	2.7 >2	1.1 EPS>0

RANK	股票代號	股票名稱	持股比重	20240506收盤價	20240506總市值(億)	近60日平均成交金額(億)	2024Q2ESG評等(總分10分)	近十年現金股利殖利率(%)	2023年度現金股利(元)	2023年-現金股利殖利率(%)
1	2603	長榮	9.5%	180.5	3,881	67	8	7.1	10.0	5.5
2	2303	聯電	6.2%	51.7	6,478	35	8	4.7	3.0	5.8
3	3034	聯詠	3.8%	635	3,864	34	8	6.7	32.0	5.0
4	2404	漢唐	3.3%	389	741	11	6	7.3	21.0	5.4
5	3293	鈺象	3.2%	1005	1,416	17	7	4.6	35.0	3.5
6	3711	日月光投控	3.1%	148	6,501	25	8	4.5	5.2	3.5
7	4938	和碩	3.1%	99.6	2,654	13	8	5.7	4.0	4.0
8	5483	中美晶	3.0%	197	1,155	16	7	4.1	未公布	
9	2385	群光	2.8%	209.5	1,592	16	10	5.8	7.8	3.7
10	2454	聯發科	2.8%	1035	16,556	93	9	5.0	55.0	5.3
11	5347	世界	2.7%	92.1	1,510	12	8	4.7	4.5	4.9
12	2891	中信金	2.7%	36.1	7,264	15	8	4.6	1.8	5.0
13	6488	環球晶	2.6%	529	2,529	15	8	4.2	未公布	
14	2382	廣達	2.6%	262	10,120	106	7	5.7	9.0	3.4
15	6139	亞翔	2.4%	254.5	593	23	6	4.2	9.0	3.5
16	2301	光寶科	2.2%	99.4	2,339	24	8	5.8	4.5	4.5
17	6121	新普	2.2%	428.5	793	10	10	6.0	21.7	5.1
18	1504	東元	2.1%	56.6	1,211	13	8	3.6	2.2	3.9
19	1216	統一	2.1%	77.6	4,409	7	8	3.9	3.0	3.9
20	1319	東陽	2.0%	115.5	683	9	6	3.3	4.0	3.5
21	6239	力成	2.0%	168.5	1,279	15	7	5.2	7.0	4.2
22	6147	頤邦	1.9%	77.5	577	5	7	5.7	3.8	4.8
23	3706	神達	1.8%	43.2	521	14	8	4.2	1.3	3.0
24	3702	大聯大	1.8%	91.8	1,725	9	8	5.9	3.5	3.8
25	3264	欣銓	1.7%	72	353	6	7	5.0	3.3	4.6
26	6414	樺漢	1.6%	324	444	11	9	2.7	11.4	3.5
27	2474	可成	1.6%	220.5	1,500	5	6	4.4	10.0	4.5
28	4915	致伸	1.6%	96.2	445	5	10	4.9	4.0	4.2
29	3042	晶技	1.5%	112	347	5	7	5.8	4.5	4.0
30	3596	智易	1.4%	172	379	4	8	5.1	7.0	4.1

# 選股預測:有機會納入

殖利率>3.9%標的

股號	公司	市值	ESG分數 (1Q24)	2023年現金殖利率	2024年現金股利殖利率(估)			
				殖利率(%)	EPS	Payout	現金股利	殖利率(%)
6269	台郡	312.5	6	5.2%	5.9	61.6	3.7	3.8%
5508	永信建	502.2	7	4.9%	18.8	90.0	16.9	7.3%
2618	長榮航	2017	7	4.8%	2.7			
2393	億光	299.7	7	4.7%	3.8	88.8	3.4	5.0%
1102	亞泥	1578.2	8	4.7%	3.0	66.6	2.0	4.5%
6670	復盛應用	364.5	7	4.6%	24.0	65.1	15.6	5.7%
5009	榮剛	337.9	7	4.5%	4.4	62.8	2.7	4.9%
2606	裕民	463.1	7	4.4%	4.0	61.2	2.5	4.5%
2211	長榮鋼	625.7	8	4.3%	7.6	83.6	6.4	4.2%
8112	至上	527.5	8	4.2%	6.1	76.3	4.6	4.8%
2504	國產	583.5	7	4.2%	3.2	67.1	2.1	4.3%
6278	台表科	345	6	4.2%	9.4	52.1	4.9	4.1%
8926	台汽電	338.9	7	4.2%		93.2		
6691	洋基工程	340	6	4.2%		81.0		
2105	正新	1564	7	4.1%	2.6	85.1	2.2	4.6%
4766	南寶	439	7	4.1%	21.4	75.5	16.1	4.4%
3045	台灣大	3909.5	9	4.1%	3.1	100.0	3.1	3.0%
5434	崇越	473.6	8	4.0%	17.1	65.0	11.1	4.4%
3010	華立	329.7	7	4.0%		57.5		
4904	遠傳	2992.7	9	3.9%	3.0	100.0	3.0	3.7%

更新至2024/5/6

# 選股預測:高機率剔除

股號	公司	市值	ESG分數 (1Q24)	2023年	2024年現金股利殖利率(估)				剔除原因
				殖利率(%)	EPS	Payout	現金股利	殖利率(%)	
3293	鈺象	1416	7	3.5%	57.0	100.0	57.0	5.7%	殖利率跌出65名外
3711	日月光投控	6500.9	8	3.5%	9.2	59.3	5.4	3.7%	殖利率跌出65名外
2382	廣達	10120	7	3.2%	12.5	81.0	10.1	3.9%	殖利率跌出65名外
6139	亞翔	592.7	6	3.5%		84.7			殖利率跌出65名外
1319	東陽	683.2	6	3.5%	6.6	73.5	4.8	4.2%	殖利率跌出65名外
3706	神達	521.3	8	2.3%	1.8				殖利率跌出65名外
3702	大聯大	1725	8	3.8%	4.3	64.4	2.7	3.0%	負債比過高
5388	中磊	359.5	7	3.5%	9.9	61.2	6.1	5.0%	負債比過高
5876	上海商銀	2280.1	8	3.8%	3.9	56.7	2.2	4.7%	負債比過高
9921	巨大	819.5	7	2.4%	9.6	57.0	5.4	2.6%	殖利率跌出65名外
2352	佳世達	792.6	9	3.0%	2.6	62.1	1.6	3.9%	殖利率跌出65名外
3005	神基	637.3	8	3.3%	7.0	73.1	5.1	4.9%	已除息
9904	寶成	1037.3	7	3.1%	4.0	30.5	1.2	3.4%	殖利率跌出65名外
6605	帝寶	325.8	3	3.3%		45.1			殖利率跌出65名外
1785	光洋科	257.3	7	2.8%	2.4	66.3	1.6	3.7%	殖利率跌出65名外
5469	瀚宇博	288	7	2.9%					殖利率跌出65名外
2027	大成鋼	904.3	7	3.2%	2.1				殖利率跌出65名外
6146	耕興	250.2	6	4.3%	15.3	76.0	11.6	4.7%	市值跌出300大
1723	中碳	266.5	8	3.6%	6.0	72.5	4.4	3.9%	流動性不足
3704	合勤控	166.3	8	3.7%	3.7				市值跌出300大

更新至2024/5/6