



中華證券交易服務有限公司

CHINA EXCHANGES SERVICES
COMPANY LIMITED

中华交易服务陆股通行业龙头指数编制方案

2023年8月



目录

引言	3
1、指数名称与代码	4
2、指数基日与基点	4
3、样本选取方法	4
4、指数计算	5
5、指数样本调整	5
6、样本股权重调整	6
7、指数规则的修订和补充	6
8、信息披露	6
联系我们	7

引言

中华交易服务陆股通行业龙头指数(中华陆股通行业龙头)由中华证券交易服务有限公司(中华交易服务)编制,由中华交易服务以及深圳证券信息有限公司(深证信息)共同维护。

中华陆股通行业龙头为证券价格指数,旨在追踪互联互通A股市场最有代表性的行业龙头股票表现。

指数简称	发布日	指数样本
中华陆股通行业龙头	28-12-2018 ¹	在互联互通A股市场中,选取盈利高、市值大、流动性好、最具代表性的50只行业龙头股票

¹ 中华A股外资优先配置指数于2023年8月22日开始以实时发布。

1、指数名称与代码

指数名称	指数简称	指数货币	指数代码
中华交易服务陆股通行业龙头指数	中华陆股通行业龙头	人民币	CESAIT
中华交易服务陆股通行业龙头全收益指数	中华陆股通行业龙头R	人民币	AITCNYG

2、指数基日与基点

该指数以2011年12月30日为基日，以2000点为基点。

3、样本选取方法

3.1 样本空间

中华陆股通行业龙头的样本空间为内地上市的沪股通及深股通合格股票名单。

香港证券交易所可不时更新后通知市场有关沪股通及深股通合格证券名单。

3.2 选样方法

中华陆股通行业龙头的样本按照以下方法选择：

- 盈利甄选：剔除连续两个财政年度每股收益 (EPS) 小于0的公司；
- 行业甄选：沪股通及深股通合格股票按四级行业分类，将每个行业内公司的一年日均总市值¹ 加总（简称：行业总市值），并将行业总市值由大至小进行排序；
- 流动性甄选：待选样本过去一年日均成交金额不少于2000

万人民币，如选出的某个行业其所有股票均不符合流动性要求，此行业将由市值排名较后的行业取代；

- 龙头甄选：最终选出的50个行业，根据最近一年日均总市值各挑选1只市值最大的股票为指数样本股。

^公司总市值为内地上市A股和香港上市H股的市值加总。

4、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“6、样本股权重调整”。

5、指数样本调整

5.1 定期调整

指数样本股实施半年度定期调整，于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。每次样本调整数量不超过样本总数的10%，排名45至55位的老行业优先保留。

在确定新入选样本股后，在剩余股票中按排名从高到低选取样本数量5%的股票作为备选样本股。

5.2 临时调整

当样本股退市或被调出沪股通、深股通标的清单时，将进行相应调整，同时选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

6、样本股权重调整

指数采用自由流通调整市值加权法，在指数计算时，设置调整因子，使得单只股票权重上限不超过10%。

权重调整因子每年调整2次，于样本股定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

7、指数规则的修订和补充

根据市场的发展变化和指数用户的回馈，中华交易服务和深证信息适时将对指数规则进行修订或补充。指数规则的调整须提早对市场公布。

8、信息披露

为保证指数的客观性、中立性和权威性，建立严格的信息披露制度，确保指数的透明、公开和公平。

- 任何信息在公开披露之前，任何人包括工作人员不得私自向外界公开，不得私自接受媒体采访。
- 信息披露的媒体包括但不限于中华证券交易服务有限公司及深圳证券信息有限公司网站。

联系我们

欲了解更多详情，请联络：

指数授权

中华证券交易服务有限公司

香港中环康乐广场八号交易广场一期50楼

电话：852 2803 8200

传真：852 2868 3770

电邮：cescinfo@cesc.com

网站：<https://www.cesc.com/>

客户服务

深圳证券信息有限公司(指数服务委托商)

中国广东省深圳市罗湖区深南东路5045号深业中心

电话：0086 755 8320 2239

传真：0086 755 8324 3723

电邮：index.service@cninfo.com.cn

网站：<http://www.cnindex.com.cn/>