



中華證券交易服務有限公司

CHINA EXCHANGES SERVICES
COMPANY LIMITED

中華交易服務一帶一路指數 編制方案

2023年10月



目錄

引言.....	3
1、指數名稱與代碼.....	4
2、指數基日與基點.....	4
3、樣本選取方法.....	4
4、指數計算.....	5
5、指數樣本調整.....	5
6、樣本權重調整.....	6
7、指數規則的修訂和補充.....	6
8、信息披露.....	6
聯繫我們.....	7

引言

中華交易服務一帶一路指數（中華一帶一路）由中華證券交易服務有限公司（中華交易服務）編制，由中華交易服務以及深圳證券信息有限公司（深證信息）共同維護。

中華一帶一路為證券價格指數，旨在反映積極參與“一帶一路”倡議的上市公司證券價格表現。

指數簡稱	發布日	指數樣本
中華一帶一路	03-04-2018 ¹	滬深港互聯互通合資格證券中，選取市值高、積極參與“一帶一路”倡議的50只證券。

¹ 中華一帶一路指數于2023年8月22日開始以實時發布。

1、指數名稱與代碼

指數名稱	指數簡稱	指數貨幣	指數代碼
中華交易服務一帶一路指數	中華一帶一路	人民幣	CESBNR
中華交易服務一帶一路全收益指數	中華一帶一路R	人民幣	BNRCNYG

2、指數基日與基點

該指數以2012年12月31日為基日，以1000點為基點。

3、樣本選取方法

3.1 樣本空間

中華一帶一路的樣本空間由滬股通、深股通及港股通合資格證券組合而成，公司業務範圍覆蓋一帶一路沿綫國家，剔除滬深市場ST及*ST證券。

3.2 選樣方法

中華一帶一路的樣本按照以下方法選擇：

- 按國證二級行業進行劃分，選取全部國證一級行業下的22個國證二級行業的上市公司；
- 根據一帶一路企業影響力評分方法，綜合考察企業性質、企業影響力、盈利能力和外貿能力等因素，選取總得分不低於50分的證券；
- 按最近一年日均成交金額由高到低排序，剔除流動性排名後10%的證券；

- 對篩選後的證券按照過去一年日均總市值由高到低排名，選取前50只證券構成指數樣本。
- 對於兩地上市公司，選取主上市地的證券作為樣本。

4、指數計算

指數採用派氏加權法，依據下列公式逐日連鎖實時計算：

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子} \times \text{汇率})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子} \times \text{汇率})}$$

其中，樣本權數調整方法參見指數計算與維護細則，權重調整因子見“6、樣本權重調整”。

5、指數樣本調整

5.1 定期調整

指數樣本實施半年度定期調整，于每年6月和12月的第二個星期五的下一個交易日實施。樣本調整方案通常在實施前兩周公布。排名在樣本數70%範圍之內的非原樣本按順序入選，排名在樣本數130%範圍之內的原樣本按順序優先保留。

在確定新入選樣本後，在剩餘證券中按排名從高到低選取樣本數量5%的證券作為備選樣本。

5.2 臨時調整

當樣本退市或被調出滬股通、深股通、港股通標的清單時，將進行相應調整，同時選擇備選樣本名單中排序最靠前的證券補足。

6、樣本權重調整

指數採用自由流通調整市值加權法，在指數計算時，設置調整因子，使得單只樣本權重不超過10%。

權重調整因子每年調整2次，于樣本定期調整時實施。在下一個定期調整日之前，權重調整因子一般固定不變。

7、指數規則的修訂和補充

根據市場的發展變化和指數用戶的反饋，中華交易服務和深證信息適時將對指數規則進行修訂或補充。指數規則的調整將提早對市場公布。

8、信息披露

為保證指數的客觀性、中立性和權威性，建立嚴格的信息披露制度，確保指數的透明、公開和公平。

- 任何信息在公開披露之前，任何人包括工作人員不得私自向外界公開，不得私自接受媒體採訪。
- 信息披露的媒體包括但不限於中華證券交易服務有限公司及深圳證券信息有限公司網站。

聯繫我們

欲瞭解更多詳情，請聯絡：

指數授權

中華證券交易服務有限公司

香港中環康樂廣場八號交易廣場一期50樓

電話：852 2803 8200

傳真：852 2868 3770

電郵：cescinfo@cesc.com

網站：<https://www.cesc.com/>

客戶服務

深圳證券信息有限公司（指數服務委托商）

中國廣東省深圳市羅湖區深南東路5045號深業中心

電話：0086 755 8320 2239

傳真：0086 755 8324 3723

電郵：index.service@cninfo.com.cn

網站：<http://www.cnindex.com.cn/>