



中華證券交易服務有限公司  

---

CHINA EXCHANGES SERVICES  
COMPANY LIMITED

# 中华交易服务粤港澳大湾区 优势产业指数编制方案

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 .....	6
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 .....	7
<b>联系我们 .....</b>	<b>8</b>

## 引言

中华交易服务粤港澳大湾区优势产业指数(中华大湾区优势产业)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。

中华大湾区优势产业为证券价格指数，旨在反映在香港或中国内地上市受惠大湾区发展的公司之股价表现。

指数简称	发布日	指数样本
中华大湾区优势产业	01-04-2019 <sup>1</sup>	在香港或中国内地上市受惠大湾区发展的股票中，选取市值大、流动性好的100只股票

<sup>1</sup> 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
中华交易服务粤港澳大湾区优势产业指数	中华大湾区优势产业	人民币	CESGBA
中华交易服务粤港澳大湾区优势产业全收益指数	中华大湾区优势产业R	人民币	GBACNYG

## 2、指数基日与基点

该指数以2015年6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

中华大湾区优势产业的样本空间为“沪股通”、“深股通”及“港股通”合资格股票，并满足以下条件：

- 归类为大湾区相关行业<sup>1</sup>
- 公司总部/主要营运中心<sup>2</sup>设于大湾区二区九市<sup>3</sup>

<sup>1</sup>根据2019年2月18日发布的《粤港澳大湾区发展规划纲要》文件内的规划方向，精选86个受惠于大湾区发展之细分行业

<sup>2</sup>辨识上市公司之总部/主要营运中心时，如有需要，母公司和/或子公司之总部/主要营运中心亦会一并考虑

<sup>3</sup>二区指香港、澳门两个特别行政区；九市指广州、深圳、珠海、佛山、东莞、中山、江门、惠州和肇庆九个城市

### 3.2 选样方法

中华大湾区优势产业的样本按照以下方法选择：

- 上市时间甄选：剔除上市交易时间少于3个月的股票；
- 价格甄选：剔除过去12个月平均股价低于1港元的港股；
- 流动性甄选：剔除过去一年日均成交周转率（每日成交股份数量除以每日上市股份数量）不足0.01%的股票；
- 成份股挑选：剩余样本公司按过去一年日均公司总市值<sup>4</sup>由高至低排名（公司排名）。剩余样本公司按四级行业分类，于各自行业内按过去一年日均公司总市值<sup>4</sup>由高至低排名（行业排名）。将先选取行业排名第一的公司<sup>5</sup>作为指数成份股，而当数目仍不足100家公司时，行业排名第二的公司则会补上，如此类推。若行业排名相等，公司排名较高的股票将优先选取。

<sup>4</sup>公司总市值包括内地上市A股、B股、香港上市股份及非上市股份的市值加总。

<sup>5</sup>若所选公司为两地同时上市AH公司，选择近一年日均市值较高的股票类别作为成份股。

## 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：

实时指数 = 上一交易日收市指数

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

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。

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、港股通标的清单时，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5%。

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反馈，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/>