



中華證券交易服務有限公司

CHINA EXCHANGES SERVICES
COMPANY LIMITED

中華交易服務粵港澳大灣區 優勢產業指數編制方案

2023年8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.....	6
6、樣本股權重調整.....	6
7、指數規則的修訂和補充.....	6
8、信息披露.....	7
聯繫我們.....	8

引言

中華交易服務粵港澳大灣區優勢產業指數(中華大灣區優勢產業)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。

中華大灣區優勢產業為證券價格指數，旨在反映在香港或中國內地上市受惠大灣區發展的公司之股價表現。

指數簡稱	發佈日	指數樣本
中華大灣區優勢產業	01-04-2019 ¹	在香港或中國內地上市受惠大灣區發展的股票中，選取市值大、流動性好的100只股票

¹ 中華A股外資優先配置指數於2023年8月22日開始以實時發佈。

1、指數名稱與代碼

指數名稱	指數簡稱	指數貨幣	指數代碼
中華交易服務粵港澳大灣區優勢產業指數	中華大灣區優勢產業	人民幣	CESGBA
中華交易服務粵港澳大灣區優勢產業全收益指數	中華大灣區優勢產業R	人民幣	GBACNYG

2、指數基日與基點

該指數以2015年6月30日為基日，以2000點為基點。

3、樣本選取方法

3.1 樣本空間

中華大灣區優勢產業的樣本空間為“滬股通”、“深股通”及“港股通”合資格股票，並滿足以下條件：

- 歸類為大灣區相關行業¹
- 公司總部/主要營運中心²設于大灣區二區九市³

¹根據2019年2月18日發佈的《粵港澳大灣區發展規劃綱要》文件內的規劃方向，精選86個受惠于大灣區發展之細分行業

²辨識上市公司之總部/主要營運中心時，如有需要，母公司和/或子公司之總部/主要營運中心亦會一併考慮

³二區指香港、澳門兩個特別行政區；九市指廣州、深圳、珠海、佛山、東莞、中山、江門、惠州和肇慶九個城市

3.2 選樣方法

中華大灣區優勢產業的樣本按照以下方法選擇：

- 上市時間甄選：剔除上市交易時間少於3個月的股票；
- 價格甄選：剔除過去12個月平均股價低於1港元的港股；
- 流動性甄選：剔除過去一年日均成交周轉率（每日成交股份數量除以每日上市股份數量）不足0.01%的股票；
- 成份股挑選：剩餘樣本公司按過去一年日均公司總市值⁴由高至低排名（公司排名）。剩餘樣本公司按四級行業分類，於各自行業內按過去一年日均公司總市值⁴由高至低排名（行業排名）。將先選取行業排名第一的公司⁵作為指數成份股，而當數目仍不足100家公司時，行業排名第二的公司則會補上，如此類推。若行業排名相等，公司排名較高的股票將優先選取。

⁴公司總市值包括內地上市A股、B股、香港上市股份及非上市股份的市值加總。

⁵若所選公司為兩地同時上市AH公司，選擇近一年日均市值較高的股票類別作為成份股。

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，樣本股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、樣本股權重調整”。

5、指數樣本調整

5.1 定期調整

指數樣本股實施半年度定期調整，於每年6月和12月的第二個星期五的下一個交易日實施。樣本股調整方案通常在實施前兩周公佈。

在確定新入選樣本股後，在剩餘股票中按排名從高到低選取樣本數量5%的股票作為備選樣本股。

5.2 臨時調整

當樣本股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，同時選擇備選樣本股名單中排序最靠前的股票補足。

6、樣本股權重調整

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，使得單只股票權重上限不超過5%。

權重調整因子每年調整2次，於樣本股定期調整時實施。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。指數規則的調整須提早對市場公佈。

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(指數服務委託商)

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/>