



中華證券交易服務有限公司

CHINA EXCHANGES SERVICES
COMPANY LIMITED

中華交易服務半導體芯片 行業指數編制方案

2020年12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、 指數樣本權重調整	5
6、 指數規則的修訂和補充	6
7、 資訊披露	6
聯繫我們.....	8

引言

中華交易服務半導體芯片行業指數(中華半導體芯片)由中華證券交易服務有限公司(中華交易服務)委託中證指數有限公司(中證指數)進行編制，指數編制方案由中華交易服務以及中證指數共同確定。

中華半導體芯片為證券價格指數，旨在追蹤滬深市場半導體芯片行業上市公司的整體表現，相關公司經營範圍涵蓋半導體芯片材料、設備、設計、製造、封裝和測試。

指數簡稱	發布日 ¹	指數樣本
中華半導體芯片	26-09-2018	從滬深市場證券半導體芯片行業上市公司中，選取市值排名在前50名的證券作為指數樣本

¹ 即時指數的發布日為 18-03-2019

1、 指數名稱與代碼

指數名稱	指數簡稱	指數貨幣	指數代碼
中華交易服務半導體芯片行業指數	中華半導體芯片	人民幣	990001
中華交易服務半導體芯片行業指數	中華半導體芯片	港元	990002
中華交易服務半導體芯片行業全收益指數	中華半導體芯片全收益	人民幣	980001
中華交易服務半導體芯片行業全收益指數	中華半導體芯片全收益	港元	980002

2、 指數基日與基點

該指數以 2011 年 12 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

中華半導體芯片的樣本空間由同時滿足以下條件的滬深市場證券組成：

- 在審核截止日,於主機板或中小企業板或創業板上市的證券必須上市時間超過三個月；及
- 在審核截止日,於科創板上市的證券必須上市時間超過一年；及
- 非 ST、*ST 證券；及
- 過去一年無重大違法違規事件、財務報告無重大問題。

3.2 選樣方法

中華半導體芯片的樣本按照以下方法選擇：

- 流動性甄選：樣本空間內證券按照日均成交金額[^]由高至低排名，保留日均成交金額排名前 80%的證券；
- 半導體芯片行業甄選：證券公司的主營業務收入須來自半導體芯片材料、設備、設計、製造、封裝或測試；
- 市值甄選：剩餘證券按照日均市值[^]由高至低排名,選取前 50 名作為指數樣本。

[^]日均成交金額（或日均市值）為：證券過去一年的日均成交金額（或日均市值）；新上市證券為上市第四個交易日至審核截止日以來的日均成交金額（或日均市值）。

4、 指數計算

指數計算公式為：

$$\text{報告期指數} = \frac{\text{報告期樣本的調整市值}}{\text{除數}} \times 2000$$

其中，調整市值= \sum (證券價格×調整股本數×匯率×權重調整因子)。調整股本數的計算方法參見計算與維護細則。在指數計算中，權重調整因子介於 0 和 1 之間，以使單個樣本權重不超過 10%。

5、 指數樣本權重調整

5.1 定期調整

指數樣本每半年調整一次，樣本調整實施時間分別是每年 6 月和 12 月的第二個星期五的下一交易日。定期調整設置緩衝區，排名在前 40 名的新樣本優先進入，排名在前 60 名的老樣本優先保留。

權重調整因子隨樣本定期調整而調整，調整時間與指數樣本定期調整實施時間相同。在下一個定期調整日前，權重調整因子一般固定不變。

在每次樣本定期調整時，設置 5 只備選樣本作為備選名單。

5.2 臨時調整

在有特殊事件發生，以致影響指數代表性與可投資性時，將對指數樣本將進行臨時調整。發生臨時調整時，由備選名單中排名最高的證券取代被剔除的證券。

6、 指數規則的修訂和補充

根據市場的發展變化和指數使用者的回饋，中華交易服務和中證指數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。

7、 資訊披露

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

- 任何資訊在公開披露之前，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。

- 資訊披露的媒體包括但不限於中華證券交易服務有限公司及中證指數有限公司網站。
- 指數樣本的定期審核結果一般提前兩周公佈；樣本臨時調整方案盡可能提前公佈；指數編制和維護規則的重大調整一般提前兩周公佈。

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二期 47 樓 4702-4704 室

電話: 852 2803 8200

傳真: 852 2868 3770

電郵: cescinfo@cesc.com

網站：<http://www.cesc.com/>

客戶服務

中證指數有限公司(指數服務委託商)

中國上海市浦東新區錦康路 308 號陸家嘴世紀金融廣場 6 號樓

13 層 (郵編：200127)

電話: 0086 21 5018 5500

傳真: 0086 21 5018 6368

電郵: csindex@sse.com.cn

網站：<http://www.csindex.com.cn/>