



中華證券交易服務有限公司

CHINA EXCHANGES SERVICES
COMPANY LIMITED

中华交易服务半导体行业 指数编制方案

2019年3月18日



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、 指数样本权重调整	5
6、 指数规则的修订和补充	6
7、 信息披露	6
联系我们	8

引言

中华交易服务半导体行业指数(中华半导体)由中华证券交易服务有限公司(中华交易服务)委托中证指数有限公司(中证指数)进行编制,指数编制方案由中华交易服务以及中证指数共同确定。

中华半导体为股票价格指数,旨在追踪中国 A 股市场半导体行业上市公司的股价表现,相关公司经营范围涵盖半导体材料、设备、设计、制造、封装和测试。

指数简称	发布日 ¹	样本股
中华半导体	26-09-2018	从 A 股半导体行业上市公司中,选取市值排名在前 50 名的股票作为样本股

¹ 实时指数的发布日为 18-03-2019

1、 指数名称与代码

指数名称	指数简称	指数货币	指数代码
中华交易服务半导体行业指数	中华半导体	人民币	CESCSC
中华交易服务半导体行业指数	中华半导体	港币	CES011
中华交易服务半导体行业全收益指数	中华半导体全收益	人民币	CES111
中华交易服务半导体行业全收益指数	中华半导体全收益	港币	CES211

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

中华半导体的样本空间由同时满足以下条件的沪深 A 股组成：

- 在审核截止日，股票必须上市超过三个月；及
- 非 ST、*ST 股票，非暂停上市股票；及
- 最近一年无重大违法违规事件、财务报告无重大问题。

3.2 选样方法

中华半导体的样本股按照以下方法选择：

- 流动性甄选：样本股按照日均成交金额由高至低排名，保留日均成交金额排名前 80%的股票；

- 半导体行业甄选：样本股的主营业务收入须来自半导体材料、设备、设计、制造、封装或测试；
- 市值甄选：剩余样本股按照日均市值由高至低排名，选取前 50 名作为指数样本。

日均成交金额（或日均市值）为：股票最近一年的日均成交金额（或日均市值）；新股为上市第四个交易日至审核截止日以来的日均成交金额（或日均市值）。

4、 指数计算

中华半导体采用以下指数公式进行计算：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期股本数的调整市值}}{\text{除数}} \times 2000$$

其中，调整市值 = Σ （股价×调整股本数×汇率×权重调整因子）。调整股本数的计算方法参见计算与维护细则。在指数计算中，权重调整因子介于 0 和 1 之间，以使样本股权重不超过 10%。

5、 指数样本权重调整

5.1 定期调整

中华半导体的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五收盘后的下一交易日。样本调整设置缓冲区，排名在前 40 名的新样本优先进入，排名在前 60 名的老

样本优先保留。

权重调整因子随样本股定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重调整因子一般固定不变。

在每次样本股定期调整时，设置 5 只备选样本股作为备选名单。

5.2 临时调整

在有特殊事件发生，以致影响指数代表性与可投资性时，将对中华半导体样本将进行临时调整。发生临时调整时，由备选名单中排名最高的股票取代被剔除的股票。

6、 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，中华交易服务和中证指数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。

7、 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



中证指数有限公司网站。

- 样本股的定期审核结果一般提前两周公布；样本股临时调整方案尽可能提前公布；指数编制和维护规则的重大调整一般提前两周公布。

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二期 9 楼 906-908 室

电话：852 2803 8200

传真：852 2868 3770

电邮：cescinfo@cesc.com

网站：<http://www.cesc.com/>

客户服务

中证指数有限公司(指数服务委托商)

中国上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼

13 层 (邮编：200127)

电话：0086 21 5018 5500

传真：0086 21 5018 6368

电邮：csindex@sse.com.cn

网站：<http://www.csindex.com.cn/>