



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行業 指數編制方案

2019年3月18日



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、 信息披露	6
聯繫我們	8

引言

中華交易服務半導體行業指數(中華半導體)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。

中華半導體為股票價格指數，旨在追蹤中國 A 股市場半導體行業上市公司的股價表現，相關公司經營範圍涵蓋半導體材料、設備、設計、製造、封裝和測試。

指數簡稱	發佈日 ¹	樣本股
中華半導體	26-09-2018	從 A 股半導體行業上市公司中，選取市值排名在前 50 名的股票作為樣本股

¹ 實時指數的發布日為 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行業指數	中華半導體	人民幣	CESCSC
中華交易服務半導體行業指數	中華半導體	港幣	CES011
中華交易服務半導體行業全收益指數	中華半導體全收益	人民幣	CES111
中華交易服務半導體行業全收益指數	中華半導體全收益	港幣	CES211

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

中華半導體的樣本空間由同時滿足以下條件的滬深 A 股組成：

- 在審核截止日，股票必須上市超過三個月；及
- 非 ST、*ST 股票，非暫停上市股票；及
- 最近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

中華半導體的樣本股按照以下方法選擇：

- 流動性甄選：樣本股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% 的股票；

- 半導體行業甄選：樣本股的主營業務收入須來自半導體材料、設備、設計、製造、封裝或測試；
- 市值甄選：剩餘樣本股按照日均市值[^]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：股票最近一年的日均成交金額（或日均市值）；新股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

中華半導體採用以下指數公式進行計算：

$$\text{報告期指數} = \frac{\text{報告期股本數的調整市值}}{\text{除數}} \times 2000$$

其中，調整市值 = Σ （股價 \times 調整股本數 \times 匯率 \times 權重調整因數）。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，權重調整因數介於 0 和 1 之間，以使樣本股權重不超過 10%。

5、 指數樣本權重調整

5.1 定期調整

中華半導體的樣本股每半年調整一次，樣本股調整實施時間分別是每年 6 月和 12 月的第二個星期五收盤後的下一交易日。樣本調整設置緩衝區，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。

權重調整因數隨樣本股定期調整而調整，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，權重調整因數一般固定不變。

在每次樣本股定期調整時，設置 5 只備選樣本股作為備選名單。

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，將對中華半導體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股票取代被剔除的股票。

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、 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。

- 樣本股的定期審核結果一般提前兩周公佈；樣本股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 9 樓 906-908 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/>