



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芯片 行业指数编制方案

2021年4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芯片行业指数(中华半导体芯片)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。

中华半导体芯片为证券价格指数,旨在追踪沪深市场半导体芯片行业上市公司的整体表现,相关公司经营范围涵盖半导体芯片材料、设备、设计、制造、封装和测试。

指数简称	发布日 <sup>1</sup>	指数样本
中华半导体芯片	26-09-2018	从沪深市场证券半导体芯片行业上市公司中,选取市值排名在前50名的证券作为指数样本

---

<sup>1</sup> 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芯片行业指数	中华半导体芯片	人民币	990001
中华交易服务半导体芯片行业指数	中华半导体芯片	港元	990002
中华交易服务半导体芯片行业全收益指数	中华半导体芯片全收益	人民币	980001
中华交易服务半导体芯片行业全收益指数	中华半导体芯片全收益	港元	980002

## 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

中华半导体芯片的样本空间由同时满足以下条件的沪深市场证券组成：

- 在审核截止日,于主板或创业板上市的证券必须上市时间超过三个月；及
- 在审核截止日，于科创板上市的证券必须上市时间超过一年；及
- 非 ST、\*ST 证券；及
- 过去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

中华半导体芯片的样本按照以下方法选择：

- 流动性甄选：样本空间内证券按照日均成交金额<sup>^</sup>由高至低排名，保留日均成交金额排名前 80% 的证券；
- 半导体芯片行业甄选：证券公司的主营业务收入须来自半导体芯片材料、设备、设计、制造、封装或测试；
- 市值甄选：剩余证券按照日均市值<sup>^</sup>由高至低排名,选取前 50 名作为指数样本。

<sup>^</sup>日均成交金额（或日均市值）为：证券过去一年的日均成交金额（或日均市值）；新上市证券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

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 2000$$

其中，调整市值=∑(证券价格×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，以使单个样本权重不超过 10%。

## 5、 指数样本权重调整

### 5.1 定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。定期调整设置缓冲区，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。

在每次样本定期调整时，设置 5 只备选样本作为备选名单。

## 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，将对指数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证券取代被剔除的证券。

## 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。
- 指数样本的定期审核结果一般提前两周公布；样本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 47 楼 4702-4704 室

电话: 852 2803 8200

传真: 852 2868 3770

电邮: [cescinfo@cesc.com](mailto: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](mailto:csindex@sse.com.cn)

网站: <http://www.csindex.com.cn/>