



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

2020 年 5 月 29 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。

中华半导体芯片为股票价格指数,旨在追踪中国 A 股市场半导体芯片行业上市公司的股价表现,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>	样本股
中华半导体芯片	26-09-2018	从 A 股半导体芯片行业上市公司中,选取市值排名在前 50 名的股票作为样本股

<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	港币	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	港币	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 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

中华半导体芯片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

日均成交金額排名前 80%的股票；

- 半導體芯片行業甄選：樣本股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：剩餘樣本股按照日均市值<sup>^</sup>由高至低排名，選取前 50 名作為指數樣本。

<sup>^</sup>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後的日均成交金額（或日均市值）。

#### 4、 指數計算

中華半導體芯片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 =  $\sum$ （股價×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

中華半導體芯片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

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，将对中华半导体芯片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 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/>