

粤港澳大湾区创新 100 指数编制方案

为落实粤港澳大湾区发展规划，助力大湾区打造国际科技创新中心，反映大湾区内创新型企业的发展状况和证券价格表现，提供业绩比较基准和投资标的，编制粤港澳大湾区创新 100 指数。

一、代码与名称

指数名称：粤港澳大湾区创新 100 指数

指数简称：湾创 100

英文名称：The Greater Bay Area Innovation 100 Index

英文简称：GBA Innovation 100

指数代码：980001

指数名称：粤港澳大湾区创新 100 指数(港币)

指数简称：湾创 100(港币)

英文名称：The Greater Bay Area Innovation 100 Index(HKD)

英文简称：GBA Innovation 100(HKD)

指数代码：980002

二、基日与基点

指数的基日为 2017 年 6 月 30 日，基点为 1000 点。

三、选样空间

在内地交易所和香港交易所上市，并满足以下条件的证券：

1. 满足内地与香港资本市场互联互通标的的证券资格；
2. 证券发行主体的注册地或运营总部在粤港澳大湾区，包括：广州市、深圳市、珠海市、佛山市、惠州市、东莞市、中山市、江门市、肇庆市，以及香港、澳门两个特别行政区。

四、选样方法

1. 从样本空间中，筛选属于先进制造业、战略性新兴产业、现代服务业、海洋经济产业的公司；
2. 根据工信部下属赛迪顾问对上市公司创新能力的评价结果，并综合考察上市公司的市值规模、行业代表性、行业覆盖面等因素，选取 100 家公司；
3. 对于两地上市公司，选取主上市地的证券作为样本。

五、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子} \times \text{汇率})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子} \times \text{上一交易日汇率})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本权重调整”。

六、样本调整

1. 样本定期调整

指数样本实施半年定期调整，于每年 6 月和 12 月的第二个周五的下一个交易日实施。样本调整方案通常在实施前两周公布。

在确定新入选样本后，在剩余证券中按选样指标从高到低排序选取样本数量 5% 的证券作为备选样本。

2. 样本临时调整

若互联互通标的清单发生调整，且剔除证券为粤港澳大湾区创新 100 指数样本，则同步剔除该样本，产生的样本空缺由备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

七、样本权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本在每次样本定期调整时的权重上限不超过 10%，同时，国证行业分类下的一级行业权重不超过 30%。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除证券在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进样本的权重调整因子。