

深港通手机产业链指数编制方案

为反映深港两市手机产业链相关上市公司的整体表现，向投资者提供更丰富的指数化投资标的，推进指数基金产品的开发，编制深港通手机产业链指数。指数包括纯价格指数和全收益指数，分别以人民币和港币计价。

一、代码与名称

指数代码	指数名称	指数简称	英文名称	英文简称
G10009	深港通手机产业链指数	深港通手机产业链	CNI Shenzhen-Hong Kong Stock Connect Smartphone Industry Index	CNI SZHKC Smartphone
G10010	深港通手机产业链全收益指数	深港通手机产业链 R	CNI Shenzhen-Hong Kong Stock Connect Smartphone Industry Total Return Index	CNI SZHKC Smartphone TRI
G10011	深港通手机产业链指数(港币)	深港通手机产业链(港币)	CNI Shenzhen-Hong Kong Stock Connect Smartphone Industry Index (HKD)	CNI SZHKC Smartphone (HKD)
G10012	深港通手机产业链全收益指数(港币)	深港通手机产业链 R(港币)	CNI Shenzhen-Hong Kong Stock Connect Smartphone Industry Total Return Index (HKD)	CNI SZHKC Smartphone TRI (HKD)

二、基日与基点

指数基日为 2011 年 12 月 30 日，基点为 1000 点。

三、选样空间

在深圳证券交易所、香港交易所上市，并满足以下条件的股票：

1. 深港通业务下的深股通及港股通所有入围股票；
2. 公司业务领域属于智能手机产业链，与制造智能手机相关，包括整机、手机结构件及上游核心材料等。

四、选样方法

计算入围选样空间股票在最近半年和最近一年的日均换手率和日均成交金额，剔除：

1. 任一区间日均换手率低于 0.05% 的股票；
2. 最近半年日均成交金额低于 40 万美元或等值人民币或港币的股票；
3. 最近一年日均成交金额低于 30 万美元或等值人民币或港币的股票；
4. 任一区间日均换手率低于 0.1% 且对应区间日均成交金额低于 200 万美元或等值人民币或港币的股票；

对选样空间剩余股票按照最近一年日均总市值从高到低排序，选取前 50 只股票，构成深港通手机产业链指数样本股。

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：

$$\begin{aligned} & \text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \\ & \times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子} \times \text{汇率})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子} \times \text{上一交易日汇率})} \end{aligned}$$

其中，样本股权数调整方法和汇率参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本股权重调整”。

六、样本股调整

1. 样本股定期调整

指数样本股每半年定期调整一次，于每年 6 月和 12 月的第二个周五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%。

2. 样本股临时调整

当样本股暂停上市、退市或被调出深港通标的清单时，将其从指数样本中同步调出。产生的样本空缺由备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

七、样本股权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本股在每次样本定期调整时的权重不超过10%。

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

当样本股名单发生变化时，调整因子进行相应调整。