

## 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、 指数代码与名称

指数代码	指数名称	指数简称	指数英文名称	指数英文简称
G10009	深港通手机产业链指数	深港通手机产业链	CNI SZ-HK CONNECT SMARTPHONE INDUSTRY INDEX	CNI SZHKC SMARTPHONE INDUSTRY
G10010	深港通手机产业链收益指数	深港通手机产业链 R	CNI SZ-HK CONNECT SMARTPHONE INDUSTRY INDEX R	CNI SZHKC SMARTPHONE INDUSTRY R
G10011	深港通手机产业链指数(港币)	深港通手机产业链(港币)	CNI SZ-HK CONNECT SMARTPHONE INDUSTRY INDEX (HKD)	CNI SZHKC SMARTPHONE INDUSTRY (HKD)
G10012	深港通手机产业链收益指数(港)	深港通手机产业链 R(港)	CNI SZ-HK CONNECT	CNI SZHKC SMARTPHONE INDUSTRY R

	币)	币)	SMARTPHONE INDUSTRY INDEX R (HKD)	(HKD)
--	----	----	---	-------

## 二、 基日与基点

指数基日为 2011 年 12 月 30 日，基点为 1000 点。

## 三、 选股原则

### 1. 入围标准

(1) “深港通”业务下的深股通及港股通（以下简称“深港通”）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。

### 2. 选样方法

在满足入围标准的股票中，计算前 6 个月和前 12 个月的日均换手率和日均成交金额（上市时间不足的，按实际成交区间计算），删除：

- (1) 任一区间日均换手率低于 0.05% 的股票；
- (2) 前 6 个月日均成交金额低于 40 万美元或等值人民币或港币的股票；

(3) 前 12 个月日均成交金额低于 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；

剩余股票共同构成选样空间，将选样空间中的股票按过去一年日均总市值从高到低排序，得到市值排名，选取深港两市排名靠前的 50 只股票，构成深港手机产业链指数样本股。

#### 四、 指数计算方法

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 =

$$\text{上一交易日收市数据} \times \frac{\sum(\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{调整因子} \times \text{汇率})}{\sum(\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{调整因子} \times \text{上一交易日汇率})}$$

**样本股：**指纳入指数计算范围的股票。

**样本股权数：**为样本股的自由流通量，子项和母项的权数相同。

**调整因子：**见“七、样本股权重调整”。

**汇率：**采用深圳证券交易所每日发布的国际市场互联参考汇率中间价。

**分子与分母：**分子项中的乘积为样本股实时自由流通市值，分母项中的乘积为样本股上一交易日收市自由流通市值。

**Σ 符号**：是指对纳入指数计算的样本股自由流通市值进行汇总。

**自由流通量**：上市公司实际可供交易的流通股数量。

**自由流通市值**：股票价格乘以自由流通量。

**股票价格选取**：样本股当日无成交的，取上一交易日收市价。样本股收市、暂停交易的，取最近成交价。

## 五、 样本股定期调整

### 1 . 定期调整时间

深港通手机产业链指数定期调整时间为每年的 1 月与 7 月的第一个交易日。

### 2 . 缓冲区规则和调整比例

( 1 ) 市值排名在样本数 70% 范围内的非原样本股按顺序优先入选；

( 2 ) 市值排名在样本数 130% 范围内的原样本股按顺序优先保留；

( 3 ) 结合上市公司基本面情况以及指数专家委员会的意见调整样本股，每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%。

## 六、 样本股临时调整

## 1. 快速剔除规则

若“深港通”入围股票清单调整，且剔除的股票为深港通手机产业链指数样本股，则深港通手机产业链指数同步剔除该样本股，产生的样本股空缺由选样空间中排名最高的非样本股补足。

## 2. 收购合并

公司发生收购合并的，按以下几种情形处理：

**样本股公司合并：**合并后的新公司股票保留样本股资格，产生的样本股空缺由选样空间中排名最高的非样本股补足。

**样本股公司合并非样本股公司：**合并后的新公司股票保留样本股资格。

**非样本股公司合并样本股公司：**样本股由“深港通”范围内的非样本股公司收购或接管时，若合并后的新公司仍满足入围标准且股票排名高于选样空间排名最高的非样本股，则新公司股票替换原样本股，成为新的指数样本；若未满足以上条件，自该样本股退市日起，由选样空间中排名最高的非样本股替换该样本股，成为新的指数样本。

## 3. 分拆

样本股公司分拆为两家或多家新公司，按以下情形处理：

若新公司股票仍然符合入围标准，且排名高于原样本股中排名最低的股票，则新公司股票替换被分拆公司，成为新的指数样本。若入选数量超过1只，则剔除原样本股中排名最低的股票，保持指数样本股数量不变。

若新公司股票仍然符合入围标准，且排名全部低于原样本股中排名最低的股票，但全部或部分公司股票高于选样空间中排名最高的非样本股，则新公司股票中排名最高的股票替换被分拆公司股票。

若新公司股票不符合入围标准，或排名全部低于选样空间中排名最高的非样本股，则由选样空间中排名最高的非样本股替换被分拆公司股票。

## 七、 样本股权重调整

### 1. 样本股权重限制

深港通手机产业链指数中，按自由流通市值计算个股权重后，设置权重调整因子使单只样本股或 AH 股在每次样本定期调整时的初始权重不超过 10%。

### 2. 权重定期调整

权重调整因子每年调整 2 次，调整时间为样本股定期调整实施日，以权重调整前倒数第 5 个交易日的收盘调整市值来计算权重调整因子。

### 3. 权重临时调整

在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本股临时调整时，新纳入指数的样本股继承被剔除样本股在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新样本股的权

重调整因子。

当样本股股本结构出现显著变化或者其它原因导致其权重发生突变时，或在其他特殊情况下，将决定是否对权重因子进行临时调整。

## 八、 指数的调整计算

同深港通 100 指数。

## 九、 指数的发布与管理

同深港通 100 指数。

## 十、 免责声明

同深港通 100 指数。