

中证粤港澳大湾区发展主题指数系列编制方案

中证粤港澳大湾区发展主题指数反映受益于粤港澳大湾区发展相关上市公司的整体表现。该指数系列包含中证港股通粤港澳大湾区发展主题指数、中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数和中证粤港澳大湾区发展主题指数，分别从港股通合格证券范围、沪港深三地上市公司及内地市场中的粤港澳大湾区企业中选取符合湾区发展主题的最大 50 只香港市场证券、最大 100 家公司及最大 100 只内地市场证券作为指数样本，并结合湾区经济发展特点和样本空间内科技类证券权重调整科技证券行业因子，以使指数样本中科技类证券权重与待选空间中科技类证券占比接近。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	指数代码 (人民币)	指数代码 (港元)
中证港股通粤港澳大湾区发展主题指数	HKC 大湾区	931001	930998
中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数	SHS 大湾区	930999	931002
中证粤港澳大湾区发展主题指数	大湾区	931000	

二、指数基日和基点

该指数以 2016 年 12 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

内地市场：中证全指指数样本与开放式公募基金可投资的其他标的；

香港市场：中证港股通综合指数样本与开放式公募基金可投资的其他标的。

2、可投资性筛选

对于内地市场证券，过去一年日均成交金额排名位于样本空间内内地市场证券的前 80%；对于香港市场证券，过去一年日均成交金额不低于 3000 万港元。

3、选样方法

该指数系列按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题的公司：

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取符合下列三个条件之一的证券为粤港澳大湾区企业证券：注册在粤港澳大湾区；公司营运中心在粤港澳大湾区；公司主营业务收入 50%以上来自粤港澳大湾区。其中粤港澳大湾区指的是由广州、佛山、肇庆、深圳、东莞、惠州、珠海、中山、江门 9 市和香港、澳门两个特别行政区形成的城市群。

(2) 对于粤港澳大湾区企业证券，选取下列行业的证券作为待选样本：交通基础设施、港口航运、现代服务业、公用事业、消费升级、高端制造、信息技术、环保。

(3) 在上述待选样本中，按过去一年日均总市值排名，选取排名前 50 的香港市场证券作为中证港股通粤港澳大湾区发展主题指数样本，选取排名前 100 的内地市场证券作为中证粤港澳大湾区发展主题指数样本；按过去一年日均公司总市值排名，选取排名前 100 的公司，其旗下内地市场证券及香港市场证券作为中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数样本。

四、指数计算

1、中证港股通粤港澳大湾区发展主题指数和中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数的计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = Σ (证券价格 × 调整股本数 × 权重因子 × 汇率)。汇率、调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子由行业调整因子和权重上限因子共同确定，符合科技类证券定义的证券行业调整因子为 2，其他证券行业调整因子为 1。科技类证券指属于信息技术、通讯服务、航空航天与国防、电力设备、机械制造、医药卫生、乘用车及零部件以及化学制品等行业且研发营收比（研发投入/营业收入）较高的证券。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%。

2、中证粤港澳大湾区发展主题指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = Σ （证券价格 × 调整股本数 × 权重因子）。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子由行业调整因子和权重上限因子共同确定，符合科技类证券定义的证券行业调整因子为 2，其他证券行业调整因子为 1。科技类证券指属于信息技术、通信、航空航天与国防、电气设备、机械制造、医药卫生、汽车与汽车零部件以及化学制品等行业且研发营收比（研发投入/营业收入）较高的证券。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%。

五、指数样本和权重调整

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为每年 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，对于中证港股通粤港澳大湾区发展主题指数，排名在 40 名之前的新样本优先进入；排名 60 名之后的老样本优先剔除。对于中证粤港澳大湾区发展主题指数和中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数，排名在 80 名之前的新样本优先进入；排名 120 名之后的老样本优先剔除。权重因子随样本定

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，权重因子一般固定不变。

2、临时调整

特殊情况下将对该指数系列进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当港股通范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时，指数将相应调整。