

中证沪港深数字经济主题指数编制方案

中证沪港深数字经济主题指数从沪港深三地市场中选取涉及数字经济基础设施和数字化程度较高的应用领域上市公司证券作为指数样本，以反映沪港深市场数字经济主题上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证沪港深数字经济主题指数

指数简称：SHS 数字经济

英文名称：CSI SH-HK-SZ Digital Economy Index

英文简称：SHS Digital Economy

指数代码：931583（人民币）/931583HKD00（港元）

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

沪深市场：同中证全指指数的样本空间；

香港市场：中证港股通综合指数样本。

2、选样方法

（1）对样本空间内的沪深市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的证券；对样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日

均成交金额不足 3000 万港元的证券；

(2) 对剩余证券中，选取涉及以下数字经济相关业务的上市公司证券作为待选样本：

- ▶ 基础设施领域：通信设备、电子设备、电脑与外围设备、半导体等；
- ▶ 主要应用领域：线上购物、快递物流、影视娱乐、网络游戏、视频直播、在线教育、远程医疗、车联网等；

(3) 在上述待选样本中，根据基础设施领域和主要应用领域证券的过去一年日均总市值占比分配样本数量。分别在基础设施领域和主要应用领域内，按照过去一年日均总市值由高到低排名选样，合计选取 50 只证券作为指数样本。若同一家公司的沪深市场证券和香港市场证券同时入选，则仅纳入该公司的沪深市场证券。

四、指数计算

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。汇率及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。权重调整因子介于 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。

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

特殊情况下将对指数进行临时调整。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。