

富时港股通智能驾驶指数

v1.0

本指数无意也无计划供欧盟或英国的受监管实体使用，因此《欧盟基准条例》*和《英国基准条例》#不适用于本指数。因此，根据《欧盟基准条例》第3条第1款第7项的规定，欧盟及英国境内的受监管实体不得将本指数用作基准。

特此说明，富时国际有限公司以及伦敦证券交易所集团的任何其他成员均不是本指数的基准管理人（定义见《欧盟基准条例》第3条第1款第6项）。

* [欧洲议会和理事会 2016 年 6 月 8 日关于用作金融工具和金融合同中基准、或用于衡量投资基金绩效的指数的条例（欧盟）2016/1011。](#)

[基准（修订和过渡性条款）（退出欧盟）条例 2019（此条例为《欧盟基准条例》在英国的修订版本）。](#)

特此说明，本指数的编制方法未使用人工智能技术。

目录

第一部分 导言	3
第二部分 管理职责	4
第三部分 富时罗素指数政策	5
第四部分 合资格证券	7
第五部分 定期审核和权重方法	8
第六部分 成分股公司的变更	11
第七部分 公司行为和事件	12
第八部分 股息处理	13
第九部分 指数计算	14
附录 A 计算时间表	15
附录 B 指数状态	16
附录 C 更多信息	17

第一部分 导言

1. 导言

- 1.1 本文件将阐述由富时罗素计算的富时港股通智能驾驶指数的构建与管理基本规则。
- 1.2 富时港股通智能驾驶指数旨在反映智能驾驶领域中 30 只符合港股通交易资格且涉及传感和定位技术、决策算法、汽车电子元件和电动汽车制造环节的证券的表现。
- 1.3 本《基本规则》应与《富时港股通指数系列的基本规则》一并阅读，后者可在以下网址获取 www.lseg.com/en/ftse-russell/。
- 1.4 富时港股通智能驾驶指数在其指数设计中未考虑 ESG（环境、社会和公司治理）因素。
- 1.5 价格指数、总回报指数与税后总回报指数将于每个交易日收盘后计算。
总回报指数包含经除息调整后的收益。所有股息均按照富时总回报指数的已公布规则计入。
税后总回报指数的计算还基于与汇付公司不在同一国家/地区且不享受双重征税协定优惠的机构投资者所收取股息的最高预扣税率。
- 1.6 本指数将实时计算，并以更新频率小于 1 秒的亚秒级低延迟流式传输方式发布。
- 1.7 本指数的基准货币为港币。指数数值也可以其他币种发布。
- 1.8 指数目标和预期用途**
- 1.8.1 本指数及指数统计数据旨在反映指数定义中所涵盖的投资市场，为这些市场的精细化分析提供支持。
- 1.9 富时罗素**
- 1.9.1 富时罗素特此告知本指数用户，可能存在某些情况（包括不受富时罗素控制的外部事件）导致指数需要变更或停止，因此任何引用本指数的金融合约或其他金融工具或使用本指数衡量其业绩表现的投资基金应该能够承受，或以其他方式应对指数的变更或停止的可能性。
- 1.9.2 指数用户若意欲追踪本指数或购买声称追踪本指数的产品，应先在投资其或其客户资产前，评估指数方法的优缺点并进行独立的投资咨询。无论是否出于疏漏或其他原因，富时罗素均不会承担由于以下原因对任何人造成的损失、伤害、索赔和费用：
- 对本《基本规则》的任何依赖，及/或
 - 本《基本规则》中的任何不准确之处，及/或
 - 任何对本《基本规则》中描述的政策和程序的不恰当使用和误用，及/或
 - 本指数或任何成分股资料的不准确之处。

第二部分

管理职责

2. 管理职责

2.1 富时国际有限公司（富时）

2.1.1 富时为本指数的基准管理人。¹

2.1.2 富时将负责富时港股通智能驾驶指数的日常计算、制作和运作，并将：

- 保存所有成分股在指数中的权重记录；
- 根据本《基本规则》变更成分股及其权重；
- 定期对本指数进行审核，并按照审核结果和本《基本规则》的规定实施变更；
- 对持续维护过程中以及定期审核时实施的成分股权重变化进行公布；
- 宣传指数。

2.1.3 指数下各成分公司由其所属基础指数的基本规则及相关委员会管辖。

2.2 本《基本规则》的修订

2.2.1 本《基本规则》须由富时罗素定期审核（至少每年一次），以确保其继续恰当地反映指数目标。对本《基本规则》的任何重大修订建议均将咨询富时罗素咨询委员会及其他利益相关者（如适用）。在修订被批准前，富时罗素指数治理委员会将对通过这些咨询得到的反馈意见加以考量。

2.2.2 根据关于富时罗素股票指数系列的原则声明（《原则声明》），若富时罗素认定本《基本规则》未提及，或者无法具体、明确地适用于某事项决策时，则任何决定应尽可能遵循《原则声明》中的规定。在做出任何此类决定后，富时罗素应尽早将之告知市场。任何该等处理将不被视为对本《基本规则》的例外或改变，也不可作为未来行动的先例；但富时罗素将考虑是否应随之更新本《基本规则》，以使其更加清晰。

¹ 根据国际证券委员会组织《金融市场基准原则》和欧洲议会和欧盟理事会 2016 年 6 月 8 日关于用作金融工具和金融合同中基准、或用于衡量投资基金绩效的指数的条例（欧盟）2016/1011（欧盟基准法规）以及《基准（修订和过渡性条款）（退出欧盟）条例 2019》（英国基准条例）中对“管理人”一词的定义，富时并非该指数系列的基准管理人。

第三部分

富时罗素指数政策

3. 富时罗素指数政策

本《基本规则》应与以下政策文件一并阅读，这些文件可通过以下链接访问：

3.1 富时全球股票指数计算方法指南

该指南旨在介绍指数的计算方法，方便用户复制指数以支持其投资和交易活动，并帮助用户了解影响指数表现的因素。

[FTSE Global Equity Index Guide to Calc.pdf](#)

3.2 公司行为和事件指南

3.2.1 如需详细了解因公司行为和事件导致的成分股公司的变化，请通过以下链接参阅《公司行为和事件指南》：

[Corporate Actions and Events Guide.pdf](#)

3.3 关于富时罗素股票指数系列的原则声明（《原则声明》）

由于指数需要跟上不断变化的市场而《基本规则》却无法预测所有的偶发事件，所以当后者不能完全覆盖某个特定的事件或发展情况时，富时罗素将参考包含富时罗素编制指数理念的《声明原则》来决定合适的处理方案。《原则声明》每年接受一次审核。任何由富时提出的更改建议都会先提交给富时罗素指数政策咨询委员会讨论，然后再由富时罗素指数治理委员会予以批准通过。

富时罗素的《原则声明》可通过以下链接访问：

[Statement of Principles.pdf](#)

3.4 查询和投诉

富时罗素的投诉程序可通过以下链接访问：

[Benchmark Determination Complaints Handling Policy.pdf](#)

3.5 关于暂停交易和市场关闭的指数政策

3.5.1 关于暂停交易或市场关闭情况下的指数变化处置指南，可通过以下链接访问：

[Index Policy for Trading Halts and Market Closures.pdf](#)

3.6 客户无法进行市场交易时的指数政策

3.6.1 关于富时罗素详细的指数处置政策，可通过以下链接访问：

[Index Policy in the Event Clients are Unable to Trade a Market or a Security.pdf](#)

3.7 重新计算政策和指南

3.7.1 一旦发现不准确之处，富时罗素将按照《富时罗素指数重新计算指南》中规定的步骤，决定是否应重新计算指数以及/或重新发布相关数据产品。富时港股通智能驾驶指数的用户将通过适当的媒体获得通知。

如需更多信息, 请通过以下链接访问富时罗素网站或联系 info@ftserussell.com 以获得《富时罗素重新计算政策和指南》文件。

[Recalculation Policy and Guidelines Equity Indices.pdf](#)

3.8 关于指数编制规则变更的政策

3.8.1 关于富时罗素指数编制规则变更的详细政策, 可通过以下链接访问:

[Policy for Benchmark Methodology Changes.pdf](#)

3.9 富时罗素指数的管治框架

3.9.1 为管理好旗下指数, 富时罗素采用了一个囊括产品、服务和技术管理在内的管治框架。该框架包括伦敦证券交易所集团的三条防线风险管理框架, 旨在确保遵守国际证券委员会组织《金融市场基准原则》²、《欧盟基准条例》³和《英国基准条例》⁴。富时罗素指数的管治框架可通过以下链接访问:

[FTSE Russell Governance Framework.pdf](#)

3.10 实时状态的定义

3.10.1 如需详细了解对实时计算指数的实时状态的定义, 请参阅以下指南。

[Real Time Status Definitions.pdf](#)

² 国际证监会组织 (IOSCO) 《金融市场基准原则》最终报告, FR07/2013 年 7 月 13 日。

³ 欧洲议会和理事会 2016 年 6 月 8 日关于用作金融工具和金融合同中基准、或用于衡量投资基金绩效的指数的条例 (欧盟) 2016/1011。

⁴ 基准 (修订和过渡性条款) (退出欧盟) 条例 2019。

第四部分

合资格证券

4. 合资格证券

4.1 富时港股通全盘指数的成分股具备被纳入富时港股通智能驾驶指数的资格。

第五部分

定期审核和权重方法

5. 定期审核和权重方法

5.1 审核日期

5.1.1 富时港股通智能驾驶指数每年3月份和9月份接受一次半年度审核，以审核月第一个星期五之前星期三（价格截止日）收盘时的股价为基础。

5.1.2 审核在审核月第三个星期五收盘后实施，即下周一生效。

5.2 成分股选取标准

5.2.1 业务活动和关键词筛选

合资格证券需依据审核月第一个星期五之前星期三收盘时的 TRBC（汤森路透商业分类）业务活动分类数据及业务描述数据进行筛选。

业务活动分为两大类：非电动汽车制造商与电动汽车制造商。归入上述业务活动类别下的证券，需在其业务描述中包含下表内至少一个关键词时，方具备纳入资格。通用关键词包括：“automotive（汽车）、automobile（车辆）、smart car（智能汽车）、intelligent vehicle/smart vehicle（智能车辆）、new energy vehicle（新能源汽车）、electric vehicle（电动汽车）、electrical vehicle（电气汽车）、electronic vehicle（电子汽车）、intelligent driving（智能驾驶）、assisted driving（辅助驾驶）、smart driving（智能行驶）、autonomous driving（自动行驶）”。

TRBC 业务活动代码	TRBC 业务活动名称	类别	关键词
5210203010	电气组件与设备（NEC）	非电动汽车制造商	通用关键词
5710401014	电子元件	非电动汽车制造商	通用关键词、“lidar”（激光雷达）、“adas”（高级驾驶辅助系统）、“machine vision”（机器视觉）
5710401012	先进电子设备	非电动汽车制造商	通用关键词、“lidar”（激光雷达）、“adas”（高级驾驶辅助系统）、“machine vision”（机器视觉）
5710603011	摄影设备	非电动汽车制造商	通用关键词、“lidar”（激光雷达）、“adas”（高级驾驶辅助系统）、“machine vision”（机器视觉）
5710101010	半导体（NEC）	非电动汽车制造商	通用关键词、“machine vision”（机器视觉）、“fpga”（现场可编程门阵列）
5710101011	集成电路	非电动汽车制造商	通用关键词、“machine vision”（机器视觉）
5710201010	通信与网络（NEC）	非电动汽车制造商	通用关键词、“internet of vehicles”（车联网）、“connected vehicle”（联网汽车）

TRBC 业务活动代码	TRBC 业务活动名称	类别	关键词
5710401010	电子设备与部件 (NEC)	非电动汽车制造商	通用关键词、“lidar” (激光雷达)、“adas” (高级驾驶辅助系统)、“robotics” (机器人)
5310102010	汽车、卡车与摩托车零部件 (NEC)	非电动汽车制造商	通用关键词、“cockpit” (驾驶舱)、“infotainment” (信息娱乐)
5720102010	软件 (NEC)	非电动汽车制造商	通用关键词、“cockpit” (驾驶舱)、“infotainment” (信息娱乐)、“intelligent operating
5310102014	汽车系统	非电动汽车制造商	通用关键词
5720101016	机器学习与人工智能 (AI) 服务	非电动汽车制造商	通用关键词
5740102010	无线通信服务 (NEC)	非电动汽车制造商	通用关键词、“navigation” (导航)
5720103011	搜索引擎	非电动汽车制造商	通用关键词
5310102011	汽车车身部件	非电动汽车制造商	通用关键词，“auto parts” (汽车零部件)
5310102012	发动机与动力总成系统	非电动汽车制造商	通用关键词
5310101012	汽车与多用途车	电动汽车制造商	通用关键词
5310101014	电动 (可替代能源) 汽车	电动汽车制造商	通用关键词
5310101010	汽车与卡车制造商 (NEC)	电动汽车制造商	通用关键词
5710602011	手机与智能手机	电动汽车制造商	通用关键词
5720101010	IT 服务与咨询 (NEC)	非电动汽车制造商	通用关键词、“in-vehicle” (车载)
5720101013	技术咨询与外包服务	非电动汽车制造商	通用关键词、“in-vehicle” (车载)
5220304024	测试实验室	非电动汽车制造商	通用关键词、“in-vehicle” (车载)

5.2.1.1 参考数据业务活动分类

5.2.1.1.1 按照“参考数据业务活动分类” (TRBC) 的定义，富时港股通智能驾驶指数的成份股被划分为经济部门、业务部门、行业组、行业及活动五级分类。

5.2.1.1.2 有关 TRBC 分类的详细信息，请访问以下链接：

[TRBC Sector Classification](#)

5.2.1.2 参考数据业务描述

Worldscope 公司描述（“业务描述”）将详细说明公司所从事的主要业务活动。该描述可作为关键词输入素材，并与 TRBC 活动数据结合使用，以确定标的是否符合指数纳入资格。

关键词筛选要求仅适用于指数中新纳入的成分股，现有成分股不受该筛选标准的限制。

5.2.2 标的选取

5.2.2.1 在满足规则 5.2.1 的基础上，选取总市值排名最高的前 30 只为合格证券。

5.2.2.2 选取成分股时使用审核月第一个星期五之前星期三的收盘价进行计算。

5.3 权重方法

5.3.1 富时港股通智能驾驶指数的成分股按可投资市值加权计算权重。

5.3.2 对于根据规则 5.1.1 和 5.1.2 进行的审核，权重调整定价日为审核月的第二个星期五。

5.3.3 成分股按照以下规则每半年（3 月份和 9 月份）进行一次权重上限调整：

- 被归类为非电动汽车制造商的成分股在公司层面的上限为 10%；以及
- 被归类为电动汽车制造商的成分股在公司层面的上限为 5%，并设置 30% 的整体权重上限。

超出的权重将按比例分配给同类别内有剩余容量的所有公司。确定好上限后，指数内各成分股的权重将随其股价自由变动。

5.3.4 成分股权重调整系数的计算基于审核月权重调整定价日的收盘价，采用已发行股本及可投资性权重计算，结果于审核月审核生效日收盘后生效。

5.3.5 对于审核月权重调整定价日收盘后至审核生效日（含当日）发生的任何公司行为/事件，计算时需将之纳入考量，前提是这些行为/事件需在审核月权重调整定价日之前公布并确认。

5.3.6 于审核月权重调整定价日之后公布的公司行动/事件，即便在审核生效日（含当日）之前生效，也不会进行额外的调整。

第六部分

成分股公司的变更

6. 成分股公司的变更

6.1 两次审核之间的纳入

6.1.1 富时港股通智能驾驶指数在两次审核之间不纳入新成分股，对分拆上市标的的处理请参阅第七部分。符合条件的新增标的将在下一次半年度审核时予以考量。

6.2 两次审核之间的剔除

6.2.1 成分股若被从相应基础指数中移出，其也将被从富时港股通股票智能驾驶指数中剔除（规则 4.1）。从富时港股通智能驾驶指数中的剔除将与从相应基础指数中的移出同步执行。被剔除股票的权重将按比例分配给富时港股通智能驾驶指数的剩余成分股。

第七部分

公司行为和事件

7. 公司行为和事件

7.1 如需详细了解因公司行为和事件导致的成分股公司变动，请通过以下链接参阅针对市值加权指数的《公司行为和事件指南》：

[Corporate Actions and Events Guide.pdf](#)

公司“行为”指有预期截止日且会对股东产生影响的行为。股票价格在除权日将有所调整。这些行为包括：

- 资本偿还
- 增资配股/配股权配售
- 股票转换
- 分拆（向下分拆） / 反向拆分（股份合并）
- 发行红股（资本化或发行红利股）

公司“事件”是基于指数编制规则对可能影响指数的公司新闻（事件）的反应。例如，一家公司宣布战略股东出售其股份（二次募集）——这可导致指数中可自由流通量的权重变化。如果有必要对指数进行调整，富时将就变更的时间通知公众。

7.2 收购、合并和分拆

关于收购、合并和分拆的处置规则，请参阅针对各市值加权指数的《公司行为和事件指南》。

7.3 暂停交易

关于暂停交易的处置规则，请参阅针对市值加权指数的《公司行为和事件指南》。

第八部分

股息处理

8. 股息处理

8.1 计算标准总回报指数时将使用宣派的股息。所有股息均在除息日实施。

8.2 税后总回报指数亦根据机构投资者（与汇付公司不居住在同一国家/地区且未受益于双重征税协定）所收到股息适用的最高预扣税率计算。

关于税后指数中所使用的预扣税率，可通过以下链接访问：

[Withholding Tax Service](#)

另请参阅《富时罗素预扣税指南》，可通过以下链接访问：

[FTSE Russell Withholding Tax Guide.pdf](#)

第九部分

指数计算

9. 指数计算

9.1 计算频率

9.1.1 对有当地交易所报价的证券，富时港股通智能驾驶指数将使用实际收盘中间价或最后交易价格（如有）进行计算。

9.2 指数计算

9.2.1 富时港股通智能驾驶指数的计算将精确到小数点后八位。

9.2.2 富时港股通智能驾驶指数的计算使用以下公式：

$$\sum_{i=1}^N \frac{(p_i \times e_i \times s_i \times f_i \times c_i)}{d}$$

其中，

- $i=1, 2, \dots, N$
- N 是富时港股通智能驾驶指数中的成分股数量。
- p_i 是成分证券的最新交易价格（或上一个交易日指数收盘时的价格）。
- e_i 是将证券报价币种转换为指数基础币种所用的汇率。
- f_i 是应用在每只证券以允许更改其权重的可投资权重因子；该因子以 0 和 1 之间的数字表达，其中 1 代表 100% 的自由流通量。每只证券在其符合资格的指数中的可投资权重因子由富时罗素公布。
- c_i 是权重调整因子，可应用于某只证券以修正其在指数中的权重。
- d 是除数，代表该指数在基准日已发行的总股本。该除数可调整，以允许在不扭曲指数的前提下对单个证券的已发行股本进行更改。

附录 A

计算时间表

指数	开盘	收盘
富时港股通智能驾驶指数	09:30	16:15

*“+1”意为下一个日历日。

所有时间均为香港当地时间。

富时港股通智能驾驶指数将不在香港公众假期计算。

非基准货币的官方收盘指数值将在香港时间 16:00 收到 WMR 外汇基准收盘即期汇率后计算。

附录 B

指数状态

富时港股通智能驾驶指数实时计算。

如需详细了解实时的定义, 请参阅以下指南:

[Real Time Status Definitions.pdf](#)

附录 C

更多信息

富时罗素《基本规则》文件中使用的术语词汇表可通过以下链接获得：

[Glossary.pdf](#)

如需富时港股通智能驾驶指数的更多信息，请咨询富时罗素。

联系详情可见于富时罗素网站，也可通过 info@ftserussell.com 联系富时罗素的客户服务中心。

网站：www.lseg.com/en/ftse-russell/

免责声明

©伦敦证券交易所集团公司及其相关集团公司（“伦交所集团”）2026 年版权所有。伦交所集团包括（1）富时国际有限公司（“富时”）、（2）法兰克罗素公司（“罗素”）、（3）富时全球债务资本市场股份有限公司（“富时加拿大”）、（4）富时固定收益有限责任公司（“富时 FI”）、（5）富时（北京）咨询有限公司（“WOFE”）和（6）富时欧盟简化股份公司（“FES”）。保留所有权利。

FTSE Russell®（富时罗素）是富时、罗素、富时加拿大、富时 FI、WOFE、FES 以及其他提供伦交所集团基准和指数服务的伦交所集团机构的商业名称。“FTSE®”（富时）、“Russell®”（罗素）、“FTSE Russell®”（富时罗素）、“FTSE4Good®”、“ICB®”、“Refinitiv”（路孚特）、“WMTM”、“FR™”以及本文中使用的任何其他商标和服务标志（无论是否注册）是由伦交所集团的相关成员或其各自的许可方拥有或许可的商标和/或服务标志。

富时港股通智能驾驶指数由富时国际有限公司或其附属公司、代理方或合作伙伴计算，或代表其计算。

富时国际有限公司是获授权的基准管理机构，在英国由英国金融行为管理局（“FCA”）根据英国基准法规（FCA 参考号 796803）进行监管。富时欧盟简化股份公司是获授权的基准管理机构，在欧盟由法国金融市场管理局（“AMF”）根据欧盟基准法规进行监管。

所有信息仅供参考。本文件中包含的所有信息和数据均由伦交所集团从其认为准确且可靠的来源获得。然而，由于可能存在人为和机制上的不准确之处以及其他因素，此类信息和数据仅按“原样”提供，不提供任何形式的保证。伦交所集团的任何成员或其各自的董事、管理人员、员工、合作伙伴或许可方均未就任何信息或伦交所集团的产品或使用伦交所集团产品所得结果的准确性、及时性、完整性、适销性作出任何明示或暗示的宣称、预测、保证或陈述，包括但不限于指数、利率、数据和分析，或伦交所集团的产品对于其可能用于任何特定目的的适用性或适当性。信息的使用者应承担其可能使用或允许使用该等信息的全部风险。

伦交所集团的任何成员或其各自的董事、高级职员、雇员、合作伙伴或许可方均不对以下情况承担任何责任或义务：（1）在获取、收集、编译、解释、分析、编辑、转录、传输、传达或交付任何此类信息或数据时，或使用本文件或本文件链接时，因任何不准确之处（疏忽或其他）或其他情况而引起、导致或与之相关的任何全部或部分损失或损害，或（2）任何直接、间接、特殊、后果性或附带损害，即使伦交所集团的任何成员事先被告知由于使用或无法使用此类信息而导致此类损害的可能性。

伦交所集团的任何成员或其各自的董事、高级职员、雇员、合作伙伴或许可方均不提供投资建议，本文件中的任何内容均不应被视为构成财务或投资建议。伦交所集团的任何成员或其各自的董事、高级职员、雇员、合作伙伴或许可方均不就投资任何资产的可取性或此类投资是否会给投资者带来任何法律或合规风险作出任何陈述。投资任何此类资产的决定不应依赖本文件中提供的任何信息。不能直接投资指数和利率。将某项资产纳入指数或利率并非建议购买、出售或持有该资产，也不代表确认任何特定投资者可以合法购买、出售或持有该资产或包含该资产的指数或利率。若未从有执照的专业人士处获得具体的法律、税务和投资建议，不应根据本文件中包含的一般性信息采取行动。

未经伦交所集团相关成员的事先书面许可，不得以任何形式或通过任何方式（电子、机械、影印、录音或其他方式）复制、存储在检索系统中或传播本文件所提供信息的任何部分。使用和分发伦交所集团的数据需获得伦交所集团和/或其许可方的许可。