

中证沪港深创新药产业指数编制方案

中证沪港深创新药产业指数从内地市场以及符合港股通条件的香港上市的证券中选取主营业务涉及创新药研发和生产的上市公司证券作为待选样本，按照市值排名选取不超过 50 只最具代表性证券作为指数样本，以反映内地与香港市场创新药产业上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证沪港深创新药产业指数

指数简称：SHS 创新药

英文名称：CSI SH-HK-SZ Brand Name Drug Industry Index

英文简称：SHS Brand Name Drug

指数代码：931409（人民币）/931410（港元）

二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 12 月 31 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：同中证全指指数样本的样本空间

香港市场：中证港股通综合指数样本

2、选样方法

（1）对样本空间内的内地市场证券，按照最近一年日均成交金额由高到低

进行排名，剔除排名后 20% 的证券；对样本空间内的香港市场证券，剔除最近一年日均成交金额不足 3000 万港元的证券；

(2) 选取主营业务涉及创新药研发、生产等环节的上市公司证券作为待选样本，包括但不限于研发投入强度高的公司、有创新药品在海外或国内上市的公司以及处于创新药研发产业链的公司；

(3) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 名的证券构成指数样本，不足 50 只时全部纳入。

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 = $\sum$ (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。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本的权重不超过 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。