

中证沪港深 300 指数编制方案

中证沪港深 300 指数从内地与香港市场中选取流动性较好、市值较大的 300 只上市公司证券作为指数样本，以反映内地与香港市场上市公司证券的整体表现。

一、指数名称与代码

指数名称：中证沪港深 300 指数

指数简称：沪港深 300

英文名称：CSI SH-HK-SZ 300 Index

英文简称：SHS 300

指数代码：931395（人民币）/931396（港元）

二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 11 月 14 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：同中证全指指数的样本空间

香港市场：同中证港股通综合指数的样本空间

2、选样方法

（1）对样本空间内的内地市场证券，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 万港币的证券；

(2) 对样本空间内剩余证券，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 300 的证券作为指数样本。

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 = $\Sigma(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{汇率} \times \text{权重因子})$ 。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，以使指数样本权重满足如下条件：

- 按照样本空间内内地市场证券和香港市值证券的总市值占比分配内地市场样本和香港市场样本权重，并在内地市场样本和香港市场样本内部分别按照自由流通市值加权；
- 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 月第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整，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，权重调整因子一般固定不变。定期调整时，根据样本空间内未入选证券的总市值排名设置备选名单，备选名单中证券数量一般为

指数样本数量的 5%。

2、临时调整

特殊情况下将对该指数进行临时调整。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。当港股通证券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。