

中证港股通中国 100 指数编制方案

中证港股通中国 100 指数选取港股通范围内的最大 100 家中国上市公司作为样本，以反映港股通范围内中国上市公司的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证港股通中国 100 指数

指数简称：港股通中国 100

英文名称：CSI HK Connect China 100 Index

英文简称：HKC China 100

指数代码：930957（港元）/930958（人民币）

二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 11 月 14 日为基日，以 3000 点为基点

三、样本选取方法

1、样本空间

同中证港股通综合指数的样本空间

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额不低于 500 万港元。

2、选择方法

(1) 对样本空间内通过可投资性筛选条件的证券，选取符合下列三个条件

之一的证券作为待选样本：注册地在中国内地；公司营运中心在中国内地；公司主营业务收入 50% 以上来自中国内地；

(2) 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 100 的证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 3000$$

其中，调整市值=Σ(证券×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 月的第二个星期的下一交易日。定期调整设置缓冲区，排名在 80 名之前的新样本优先进入；排名在 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

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。如果香港市场新上市中国企业市值在香港上市公司中排名前十并纳入港股通范围，将在其纳入港股通范围后第十一个交易日快速纳入指数。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港股通资格时，将进行相应调整。