

中证港股通非银行金融主题指数编制方案

中证港股通非银行金融主题指数从港股通证券范围中选取符合非银行金融主题的不超过 50 家上市公司证券作为指数样本，以反映港股通范围内非银行金融主题上市公司的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证港股通非银行金融主题指数

指数简称：港股通非银

英文名称：CSI HK Connect Financials (ex Banks) Thematic Index

英文简称：HKC Financials (ex Banks)

指数代码：931024（港元）/931028（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

中证港股通综合指数样本

2、可投资性筛选

对样本空间内证券，计算每月的日换手率中位数作为月换手率，剔除过去 12 个月或过去 3 个月平均月换手率不足 0.1% 的证券，除非该证券过去一年日均成交金额大于 5000 万港元。

3、选样方法

(1) 对样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取保险、资本市场、抵押信贷机构、其它综合性金融服务、特殊金融服务、消费信贷等行业公司证券作为待选样本；

(2) 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 的证券作为指数样本；如果待选样本数目不足 50 只，则全部纳入。

四、指数计算

指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum$ (证券价格 $\times$ 调整股本数 $\times$ 权重因子 $\times$ 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，以使在指数样本各二级行业合计权重不变的情况下，单个样本权重不超过 15%，前五大样本权重合计不超过 60%。

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。

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。如果香港市场新上市相关行业主题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。