

中证港股通大消费主题指数编制方案

中证港股通大消费主题指数从港股通范围内选取 50 只大消费领域上市公司证券作为指数样本，以反映港股通范围内大消费主题上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证港股通大消费主题指数

指数简称：港股通大消费

英文名称：CSI HK Connect Comprehensive Consumption Thematic Index

英文简称：HKC Comp-Consumption

指数代码：931027（港元）/931031（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。

3、选样方法

（1）对样本空间内通过可投资性筛选条件的证券，选取可选消费、主要消费、医药卫生、林业产品及纸制品等行业公司的证券作为待选样本；

(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 名的证券作为指数样本；如果上述待选样本数目不足 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 × 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 15%。

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。

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相应的行业主题指数中。样本公司发生收购、合并、分拆情形的处理，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，指数将进行相应调整。