

中证沪深港黄金产业股票指数编制方案

中证沪深港黄金产业股票指数从内地与香港市场中，选取 50 只市值较大且业务涉及黄金采掘、冶炼、销售的上市公司证券作为指数样本，以反映内地与香港市场中黄金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：中证沪深港黄金产业股票指数

指数简称：SSH 黄金股票

英文名称：CSI SH-SZ-HK Gold Industry Equity Index

英文简称：SSH Gold Equity

指数代码：931238（人民币）/ 931238HKD200（港元）/ 931238USD200（美元）

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：同中证全指指数的样本空间

香港市场：中证港股通综合指数样本

2、可投资性筛选

对于内地市场证券，过去一年日均成交金额排名位于样本空间内证券的前

90%；对于香港市场证券，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) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取业务涉及黄金采掘、冶炼、销售等业务上市公司证券作为待选样本；

(2) 将待选样本按照过去一年日均总市值由高到低排名，当待选样本数量不足50只时，全部纳入，当待选样本数量超过50只时，选取排名前50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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。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，以使黄金采掘业务占比较高的公司单个公司权重不超过15%，其他单个公司权重不超过3%，其他公司权重合计不超过30%，且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。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。