

中证港股通汽车产业主题指数编制方案

中证港股通汽车产业主题指数从港股通证券范围内选取 50 只业务涉及汽车产业的上市公司证券作为指数样本，以反映港股通内汽车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：中证港股通汽车产业主题指数

指数简称：港股通汽车

英文名称：CSI Hong Kong Connect Automobile Industry Thematic Index

英文简称：HKC Automobile

指数代码：931239（港元）/ 931239CNY100（人民币中间价）

二、指数基日和基点

该指数以 2016 年 12 月 30 日为基日，以 1000 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，选取业务涉及整车制造、零部件制造等汽车相关产业的上市公司证券作为待选样本；

(2) 在上述待选样本中，优先选取主营业务为整车制造的全部上市公司证券作为指数样本，再按照过去一年日均总市值由高到低依次纳入剩余证券，使得样本数量达到 50 只。

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 = $\sum$ (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，以使整车制造企业的单个样本权重不超过 15% 且合计权重不低于 70%，其余单个样本权重不超过 3%，指数前五大样本合计权重不超过 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。