

中证港股通消费主题指数编制方案

中证港股通消费主题指数从港股通范围内选取流动性较好、市值较大的 50 只消费主题相关证券作为指数样本，以反映港股通内消费类上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证港股通消费主题指数

指数简称：港股通消费

英文名称：CSI HK Stock Connect Consumer Thematic Index

英文简称：HKC Consumer

指数代码：931454（港元）/ 931455（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 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，选取属于食品、饮料、耐用消费品、纺织服装、珠宝、休闲服务、零售业等消费领域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序，选取排名靠前的 50 只证券作为指数样本，不足 50 只时全部纳入。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

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，以使单个样本权重不超过 15%，前五大样本合计不超过 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。每次调整的样本比例一般不超过 20%。

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。