

## 中证沪港深线上消费主题指数编制方案

中证沪港深线上消费主题指数从内地与香港市场中选取 50 只主营业务涉及线上购物、数字娱乐、在线教育以及远程医疗等领域上市公司证券作为指数样本，以反映内地与香港市场线上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：中证沪港深线上消费主题指数

指数简称：SHS 线上消费

英文名称：CSI SH-HK-SZ Online Consumption Index

英文简称：SHS Online Consumption

指数代码：931481（人民币）/931482（港元）

### 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：同中证港股通综合指数的样本空间

#### 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位于样本空间中内地市场证券的前 80%；对于香港市场证券，过去一年日均成交金额不低于 1000 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，选取主营业务涉及线上购物、数字娱乐、在线教育以及远程医疗等领域上市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。当同一公司的内地市场证券和香港市场证券同时入选时，若样本公司经汇率调整后的内地市场证券价格除以香港市场证券价格的价格比率小于 1.05，则内地市场证券入选，反之香港市场证券入选。

## 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 10%，前五大样本权重合计不超过 40%。

## 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。