

## 中证沪港深指数系列编制方案

中证沪港深指数系列包括中证沪港深 500 指数、中证沪港深互联互通中小综合指数以及中证沪深港互联互通综合指数，该指数系列选取沪港深交易所上市的互联互通范围内上市公司证券作为指数样本，以全面反映沪港深三地上市企业证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	指数代码 (人民币)	指数代码 (港元)
中证沪港深 500 指数	沪港深 500	H30455	H30488
中证沪港深互联互通中小综合指数	沪港深通中小	H30456	H30489
中证沪港深互联互通综合指数	沪港深通综合	H30457	H30490

### 二、指数基日和基点

该指数系列以 2004 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

沪股通、深股通和港股通范围内的证券。

#### 2、选样方法

##### 2.1 中证沪港深 500 指数

(1) 对于样本空间内的沪深市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；对于样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日均成交金额不足 3000 万港元的证券；

(2)对于上述剩余待选证券,按照过去一年证券日均总市值从高到低排名,选取排名较高的 500 只证券成指数样本。

## 2.2 中证沪港深互联互通中小综合指数

样本空间中除中证沪港深 500 指数样本以外的证券组成中证沪港深互联互通中小综合指数的样本。

## 2.3 中证沪港深互联互通综合指数

全部样本空间内证券组成中证沪港深互联互通综合指数的样本。

# 四、指数计算

该指数系列的计算公式为:

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

其中,调整市值 =  $\Sigma(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{汇率} \times \text{权重因子})$ 。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,以使单个指数样本权重不超过 10%。

# 五、指数样本和权重调整

## 1、定期调整

该指数系列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 月第二个星期五的下一交易日。中证沪港深 500 指数每次调整的样本比例一般不超过 10%,样本调整设置缓冲区,日均总市值排名在 400 名内的新样本优先进入,排名在 600 名之前的老样本优先保留。定期调整时,中证沪港深 500 指数根据样本空间内证券的总市值排名设置备选名单,备选名单中证券数量一般为指数样本数量的 5%。中证沪港深互联互通中小综合指数和中证沪港深互联互通综合指数在定期调样时不设调样比例限制和缓冲区间。

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

如果沪深市场新发行证券的沪深市场总市值在全部沪深证券中排名前 10 位或香港市场新发行证券的香港市场总市值在香港上市证券中排名前 10 位，将在该新上市公司证券符合互联互通资格的第 11 个交易日快速纳入中证沪港深 500 指数，同时剔除原指数样本中最近一年日均总市值排名最低的证券。

特殊情况下将对该指数系列样本进行临时调整。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。当沪股通、深股通和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，将进行相应调整。