

中证香港中小企业投资主题指数编制方案

中证香港中小企业投资主题指数从香港市场中选取中小企业证券作为指数样本，以反映香港市场中小企业证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证香港中小企业投资主题指数

指数简称：港中小企

英文名称：CSI Hong Kong Mid&Small Corporations Investment Thematic Index

英文简称：HK Mid&Small Corporations

指数代码：930747（人民币）/930746（港元）

上交所转播代码：000867

二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 11 月 14 日为基日，以 3000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

同中证香港 300 指数的样本空间

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券，按照过去一年日均成交金额由高到底排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 对样本空间内剩余样本，按照过去一年日均公司总市值由高到低排名，

累计总市值覆盖前 80% 的公司定义为大型企业；累计总市值覆盖 80% 至 95% 的公司定义为中型企业；剩余公司定义为小型企业；

(3) 在中型企业和小型企业中分别选取满足港股通资格且日均公司总市值排名靠前的 50 只、100 只公司证券作为指数样本，若小型企业数量不足 100 只，则用市值较大的剩余中型企业代替。

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，以使得每只小型企业样本权重为 0.5%，每只中型企业样本权重为 1%。

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。