

中证港股通科技指数编制方案

中证港股通科技指数从港股通范围内选取 50 只市值较大、研发投入较高且营收增速较好的科技龙头上市公司证券作为指数样本，以反映港股通内科技龙头上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证港股通科技指数

指数简称：港股通科技

英文名称：CSI Hong Kong Connect Technology Index

英文简称：HKC Technology

指数代码：931573（港元）/931573CNY00（人民币）

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

中证港股通综合指数样本

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额不低于 1000 万港元。

3、选样方法

(1) 对样本空间内通过可投资性筛选条件的证券，选取通信、互联网、医

药生物、电子、半导体、新能源、航空航天与国防等行业的上市公司证券作为科技主题空间；

(2) 在科技主题空间中，剔除过去两年营业收入增速连续为负以及过去两年研发投入占营业收入的比例不足 3% 的证券，对各中证二级行业中市值排名前三的证券豁免上述要求；

(3) 在剩余证券中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，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

中证港股通科技指数的计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。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%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

中证港股通科技指数的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。如果香港市场新上市证券市值在指数样

本股中排名前十，将在其进入港股通后的第十一个交易日快速进入指数。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，指数将进行调整。