

中证香港创新药指数编制方案

中证香港创新药指数在香港市场中选取不超过 50 家主营业务涉及创新药研发的上市公司证券作为指数样本，以反映香港市场创新药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：中证香港创新药指数

指数简称：港股创新药

英文名称：CSI Hong Kong Brand Name Drug Index

英文简称：HK Brand Name Drug

指数代码：931787（港元）/ 931787CNY00（人民币）

二、指数基日和基点

该指数以 2017 年 12 月 29 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

以中证香港 300 指数的样本空间与中证港股通综合指数的样本空间取并集，作为指数的样本空间。

2、可投资性筛选

流动性要求：过去一年日均成交金额不低于 1000 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，选取业务涉及创新药研发以及为制药企业提供药物研究、开发和生产等服务的上市公司证券作为待选证券；

(2) 在上述待选证券中，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 10%。

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。