

中证香港中小企业投资主题指数编制方案

一、指数名称和代码

中文全称	中文简称	指数代码 (人民币)	指数代码 (港元)
中证香港中小企业投资主题指数	港中小企	930747	930746

二、基日和基点

中证香港中小企业投资主题指数基日为 2014 年 11 月 14 日，基点为 3000 点。

三、样本选取方法

● 样本空间

中证香港中小企业投资主题指数样本空间同中证香港 300 指数样本空间。

● 选样方法：

1. 流动性筛选：剔除样本空间中过去一年日均成交金额排名后 20% 的证券。

2. 企业划分：将剩余证券按照过去一年日均公司总市值（公司总市值指的是同一上市公司旗下所有上市证券的合计市值）进行排序，累积前 80% 的定义为大型企业；累积 80%—95% 的定义为中型企业；剩余定义为小型企业。

3. 样本选取：在中型企业及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证券，具体为：中型企业中，选取排名靠前的 50 只证券；小型企业中，选取排名靠前的 100 只证券；若小型企业数量不足，则用市值最大的中型企业来代替。每只小型企业样本股赋予 0.5% 权重，每只中型企业样本股赋予 1% 权重，合计权重等于 1。

四、指数计算与修正

中证香港中小企业投资主题指数的指数采用派许加权综合价格指数公式进行计算，计算公式如下：

报告期指数=报告期样本股的调整市值/基期*3000，其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重调整因子} \times \text{汇率})$ 。调整股本数为采用分级靠档的方法对样本股股本进行调整后的股本。权重调整因子介于 0 和 1 之间，详见第六条“权重调整因子调整”。关于汇率，详见第七条“汇率”。

五、样本股调整

中证香港中小企业投资主题指数样本股原则上每半年调整一次。

当样本公司有特殊事件发生，对样本股进行调整。这些事件包括但不限于：成份股的破产、退市、暂停上市、增发、重组、收购、吸收合并和分拆等。

当港股通资格范围发生变化时，指数样本进行相应调整。

六、权重调整因子调整

中证香港中小企业投资主题指数将采用权重调整因子，该因子使得每只小型企业样本股赋予 0.5% 权重，每只中型企业样本股赋予 1% 权重，合计权重等于 1。

权重调整因子每年随样本股定期调整而调整两次。

当出现样本临时调整以及当样本股股本结构出现显著变化或者其它原因导致其权重发生突变时，将决定是否对权重调整因子进行临时调整。

七、汇率

中证香港中小企业投资主题指数将同时公布人民币、港币指数值。计算指数所使用的汇率采用汤森路透综合汇率报价中间价。