

中证香港 1.1-1.5 倍指数系列编制方案

中证香港 1.1-1.5 倍指数系列反映基于 1.1 至 1.5 倍中证香港 50 指数日收益的回报表现。

一、指数名称和代码

| 中文全称 | 中文简称 | 指数代码 |
|--------------|--------|--------|
| 中证香港 1.1 倍指数 | CSIHK1 | 931073 |
| 中证香港 1.2 倍指数 | CSIHK2 | 931074 |
| 中证香港 1.3 倍指数 | CSIHK3 | 931075 |
| 中证香港 1.4 倍指数 | CSIHK4 | 931076 |
| 中证香港 1.5 倍指数 | CSIHK5 | 931077 |

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

指数样本包括基准指数及无风险利率两部分，其中基准指数为中证香港 50 指数，无风险利率目前参考 HIBOR 隔夜利率。

四、指数计算

该指数系列计算公式如下：

$$I_t = I_{t-1} * (1 + L * r_{under,t} - (L - 1) * \frac{r_{f,t}}{\text{interest base}})$$

| 变量 | 含义 |
|---------------|---|
| I_t | 第 t 日指数点位 |
| L | 杠杆倍数(1.1-1.5) |
| $r_{under,t}$ | 第 t 日基准指数收益率, $r_{under,t} = S_t/S_{t-1} - 1$ 其中 S_{t-1} 为基准指数在 t-1 日的点位 (收盘值), S_t 为基准指数在 t 日的点位 (实时值及收盘值)。 |
| $r_{f,t}$ | T-1 日的 HIBOR 隔夜利率 |
| interest base | 365 |