

## 中证沪港深保险行业指数编制方案

中证沪港深保险指数从保险行业投资的角度反映了在沪深港三地上市证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证沪港深保险行业指数

指数简称：沪港深保险

英文名称：CSI SH-HK-SZ Insurance Sector Index

英文简称：SHS Insurance

指数代码：930925（人民币）/930926（港币）

### 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

中证沪港深保险行业指数的样本空间由满足以下条件的证券构成：

- （1）中证全指指数样本股；
- （2）中证港股通综合指数样本股。

#### 2、选样方法

（1）对于样本空间内的港股，剔除过去一年日均成交金额小于 500 万港元的股票；对样本空间内的 A 股股票按照最近一年（新股为上市以来）的 A 股日均成交金额由高到低进行排名，剔除排名后 20% 的股票。

- （2）对剩余的证券，根据中证行业分类，选取保险公司作为中证沪深港保

险指数样本股。

#### 四、 指数计算

中证沪港深保险行业指数计算公式为：

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

其中，调整市值 =  $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。权重调整因子介于 0 和 1 之间，以使指数样本股权重不超过 15%。汇率及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。

#### 五、 指数样本和权重调整

##### 1、 定期调整

中证沪港深保险行业指数的样本股每年调整两次，样本股调整实施时间是每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整，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样本进行临时调整。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、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股不再满足港股通资格时，将进行相应调整。