

## 中证沪港深优选消费 50 指数编制方案

中证沪港深优选消费 50 指数从沪港深三地的消费类上市公司中选取 50 只盈利能力较高且兼具成长特征的龙头公司股票作为指数样本股, 以反映沪港深三地盈利能力较高且兼具成长特征的消费类龙头上市公司股票的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称: 中证沪港深优选消费 50 指数

指数简称: 优选消费 50

英文名称: CSI SH-HK-SZ Select Consumer 50 Index

英文简称: Select Consumer 50

指数代码: 931357 (人民币) /931358 (港币)

### 二、指数基日和基点

该指数以 2009 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

中证沪港深优选消费 50 指数的样本空间由满足以下条件的沪深 A 股及港股构成:

香港市场:

(1) 中证港股通综合指数样本股;

(2) 公司主营业务收入 50% 以上来自中国内地;

A 股:

(1) 上市时间超过一个季度, 除非该股票自上市以来的日均 A 股总市值在

全部沪深 A 股中排在前三 0 位；

(2) 非 ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

## 2、选样方法

(1) 对样本空间内的股票，剔除过去 60 个交易日日均成交金额低于 1000 万人民币的股票；

(2) 按照中证行业分类标准，选择消费类上市公司作为主题空间；

(3) 对剩余股票，计算其过去三年 ROE 均值-标准差因子、过去三年平均营业收入、过去三年平均经营性现金净流量、过去三年平均毛利率以及过去三年营业收入增长率指标，并对各项指标升序排列然后将所得的百分比排名简单加权平均获取综合排名，按照中证三级行业剔除排名靠后 30% 的股票；

(4) 对剩余股票，计算其过去一年 ROE-标准差因子、过去一年营业收入、过去一年经营性现金净流量、过去一年毛利率和过去一年营业收入增长率指标，对各项指标升序排列然后将所得的百分比排名简单加权平均获取综合排名，选取排名最高的 50 只股票作为指数样本股；对于含 H 股的样本股公司，若样本股公司经汇率调整后的 A 股价格除以 H 股价格的价格比率小于 1.05，则 A 股入选，反之 H 股入选。

## 四、指数计算

中证沪港深优选消费 50 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 =  $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。调整股本数的计算方法、除数修正方法以及汇率参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使个股权重不超过 10%，港股权重之和小于 80%。

## 五、指数样本和权重调整

### 1、定期调整

中证沪港深优选消费 50 指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间为每年 5 月和 11 月的第五个交易日。

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。