

中证互联互通 A 股投资主题指数编制方案

中证互联互通 A 股投资主题指数选取沪股通和深股通范围内北向资金持股市值较高的 300 只股票组成指数样本，采用持股市值加权计算，以反映沪股通和深股通范围内该类公司股票的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证互联互通 A 股投资主题指数

指数简称：互联互通 A 股投资

英文名称：CSI Stock Connect A Shares Investment Thematic Index

英文简称：Connect A Invest

指数代码：931260

二、指数基日和基点

该指数以 2017 年 3 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

中证互联互通 A 股投资主题指数的样本空间由沪股通和深股通范围内股票组成。

2、选样方法

(1) 对于样本空间内的股票，按照其在沪股通和深股通下的北向资金持股量与收盘价计算北向持股市值；

(2) 将上述持股市值按照从高到低依次排序，挑选排名靠前的 300 只股票

组成样本。

四、指数计算

中证互联互通 A 股投资主题指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使指数样本按北向资金持股市值加权，同时单一样本权重不超过 15%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

中证互联互通 A 股投资主题指数每月调整一次样本股，样本股调整实施时间分别是每月第二个星期五的下一交易日。定期调整设置缓冲区，排名在 280 名之前的新样本优先进入；排名 320 名之前的老样本优先保留。

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

特殊情况下将对该指数进行临时调整。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。当沪股通或深股通合资格范围发生变动导致样本股不再满足互联互通资格时，将进行相应调整。