



中華證券交易服務有限公司

CHINA EXCHANGES SERVICES
COMPANY LIMITED

中华交易服务香港生物科技 指数编制方案

2018年11月14日



目录

引言	3
1、 指数名称与代码	4
2、 指数基日与基点	4
3、 样本选取方法	4
4、 指数计算	5
5、 指数样本权重调整	5
6、 指数规则的修订和补充	6
7、 信息披露	6
联系我们	8

引言

中华交易服务香港生物科技指数由中华证券交易服务有限公司(中华交易服务)委托中证指数有限公司(中证指数)进行编制,指数编制方案由中华交易服务以及中证指数共同确定。

中华交易服务香港生物科技指数(中华香港生物科技)为股票价格指数,旨在反映于香港上市的生物科技公司的股价表现。

指数简称	发布日	样本股
中华香港生物科技	14-11-2018	香港上市的生物科技公司

1、 指数名称与代码

指数名称	指数简称	指数货币	指数代码
中华交易服务 香港生物科技指数	中华香港生物科技	港币	CESHKB
中华交易服务 香港生物科技指数	中华香港生物科技	人民币	CES010
中华交易服务 香港生物科技全收益指数	中华香港生物科技 全收益	港币	CES210
中华交易服务 香港生物科技全收益指数	中华香港生物科技 全收益	人民币	CES110

2、 指数基日与基点

该指数以 2014 年 12 月 12 日为基日，以 2000 点为基点。

3、 样本选取方法

3.1 样本空间

中华香港生物科技的样本空间为在香港交易所主板第一或第二上市的普通股。

3.2 选样方法

中华香港生物科技的样本股按照以下方法选择：

- 生物科技行业筛选：符合条件的股票必须根据行业分类划分为“生物科技公司”，或根据《上市规则》第十八 A 章申请上市的生物科技公司；
- 市值甄选：股票过去一年日均总市值不少于 15 亿港元。

日均总市值为：股票最近一年（新股为上市第四个交易日至审核截止日以来）的日均总市值。

4、 指数计算

中华香港生物科技采用以下指数公式进行计算：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期股本数的调整市值}}{\text{除数}} \times 2000$$

其中，调整市值 = Σ （股价 \times 调整股本数 \times 汇率 \times 权重调整因子）。调整股本数的计算方法参见计算与维护细则。

在中华香港生物科技计算中，权重调整因子介于 0 和 1 之间，以使样本股权重不超过 10%。然而，当样本股数目少于 20 只时，样本股权重上限变为 15%。当样本股数目少于 8 只时，样本股权重上限变为 25%。当样本股数目降至 5 只以下时，指数将采用等权重加权计算，即每只样本股在指数中的权重相同。

5、 指数样本权重调整

5.1 定期调整

中华香港生物科技的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五收盘后的下一交易日。

权重调整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，权重调整因子一般固

定不变。

5.2 临时调整

在有特殊事件发生，以致影响指数代表性与可投资性时，将对中华香港生物科技样本将进行临时调整。发生临时调整时，被剔除的股票至下次定期调整前不会被取代。

当样本股数目少于 20 只时，对于符合选样条件的新发行股票，启用快速进入指数的规则。即在其上市第十个交易日结束后将其纳入指数。

6、 指数规则的修订和补充

根据市场的发展变化和指数用户的回馈，中华交易服务和中证指数适时将对指数规则进行修订或补充。指数规则的调整须提早对市场公布。

7、 信息披露

为保证指数的客观性、中立性和权威性，建立严格的信息披露制度，确保指数的透明、公开和公平。

- 任何信息在公开披露之前，任何人包括工作人员不得私自向外界公开，不得私自接受媒体采访。
- 信息披露的媒体包括但不限于中证指数有限公司网站及中华证券交易服务有限公司网站。
- 样本股的定期审核结果一般提前两周公布；样本股临时调整



方案尽可能提前公布；指数编制和维护规则的重大调整一般提前两周公布。

联系我们

欲了解更多详情，请联络：

指数授权

中华证券交易服务有限公司

香港中环康乐广场八号交易广场二期 9 楼 906-908 室

电话：852 2803 8200

传真：852 2868 3770

电邮：cescinfo@cesc.com

网站：<http://www.cesc.com/>

客户服务

中证指数有限公司(指数服务委托商)

中国上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼

13 层 (邮编：200127)

电话：0086 21 5018 5500

传真：0086 21 5018 6368

电邮：csindex@sse.com.cn

网站：<http://www.csindex.com.cn/>