



中華證券交易服務有限公司  

---

CHINA EXCHANGES SERVICES  
COMPANY LIMITED

# 中華交易服務香港生物科技 指數編制方案

2019年9月19日



# 目录

引言 .....	3
1、 指數名稱與代碼 .....	4
2、 指數基日與基點 .....	4
3、 樣本選取方法 .....	4
4、 指數計算 .....	5
5、 指數樣本權重調整 .....	6
6、 指數規則的修訂和補充 .....	6
7、 信息披露 .....	7
聯繫我們 .....	8

## 引言

中華交易服務香港生物科技指數由中華證券交易服務有限公司(中華交易服務)委託中證指數有限公司(中證指數)進行編制, 指數編制方案由中華交易服務以及中證指數共同確定。

中華交易服務香港生物科技指數(中華香港生物科技)為股票價格指數, 旨在反映於香港上市的生物科技公司的股價表現。

指數簡稱	發佈日	樣本股
中華香港生物科技	14-11-2018	香港上市的生物科技公司

## 1、 指數名稱與代碼

指數名稱	指數簡稱	指數貨幣	指數代碼
中華交易服務 香港生物科技指數	中華香港生物科技	港幣	CESHKB
中華交易服務 香港生物科技指數	中華香港生物科技	人民幣	CES010
中華交易服務 香港生物科技全收益指數	中華香港生物科技 全收益	港幣	CES210
中華交易服務 香港生物科技全收益指數	中華香港生物科技 全收益	人民幣	CES110

## 2、 指數基日與基點

該指數以 2014 年 12 月 12 日為基日，以 2000 點為基點。

## 3、 樣本選取方法

### 3.1 樣本空間

中華香港生物科技的樣本空間為在香港交易所主板第一或第二上市的普通股。

### 3.2 選樣方法

中華香港生物科技的樣本股按照以下方法選擇：

- 生物科技行業甄選：符合條件的股票必須根據行業分類劃分為“生物科技公司”，或根據《上市規則》第十八 A 章申請上市的生物科技公司；
- 上市時間甄選：剔除上市交易時間不足 3 個月的股票；

- 流動性甄選：剔除過去一年日均成交周轉率<sup>^</sup>（每日成交股份數量除以每日上市股份數量）不足 0.05%且同時過去一年日均成交金額<sup>^</sup>不足 500 萬港元的股票；
- 市值甄選 剔除過去一年日均總市值<sup>^</sup>不足 15 億港元的股票。
- 經上述甄選後，剩餘股票按照過去一年日均總市值從高到低排序，選取排名靠前的 30 檔股票組成指數樣本股。剩餘股票數量不足 30 只時，全部納入。

<sup>^</sup>對於上市時間不足一年的股票，日均成交周轉率、日均成交金額和日均總市值的考察期均為上市第四個交易日至審核截止日以來。

#### 4、 指數計算

中華香港生物科技採用以下指數公式進行計算：

$$\text{報告期指數} = \frac{\text{報告期股本數的調整市值}}{\text{除數}} \times 2000$$

其中，調整市值 =  $\Sigma$ （股價 $\times$ 調整股本數 $\times$ 匯率 $\times$ 權重調整因數）。調整股本數的計算方法參見計算與維護細則。如果指數樣本股公司為多重上市，則以其公開披露於香港交易所實際交易的股數作為指數權重調整因數的計算依據。

在中華香港生物科技計算中，權重調整因數介於 0 和 1 之間，以使樣本股權重不超過 10%。然而，當樣本股數目少於 20 只時，樣本股

權重上限為 15%。當樣本股數目少於 8 只時，樣本股權重上限為 25%。當樣本股數目降至 5 只以下時，指數將採用等權重加權計算，即每只樣本股在指數中的權重相同。

## 5、 指數樣本權重調整

### 5.1 定期調整

中華香港生物科技的樣本股每半年調整一次，樣本股調整實施時間分別是每年 6 月和 12 月的第二個星期五收盤後的下一交易日。

權重調整因數隨樣本股定期調整而調整，調整時間與指數樣本定期調整實施時間相同。在下一個定期調整日前，權重調整因數一般固定不變。

### 5.2 臨時調整

在有特殊事件發生，以致影響指數代表性與可投資性時，將對中華香港生物科技樣本將進行臨時調整。發生臨時調整時，被剔除的股票至下次定期調整前不會被取代。

## 6、 指數規則的修訂和補充

根據市場的發展變化和指數使用者的回饋，中華交易服務和中證指數適時將對指數規則進行修訂或補充。指數規則的調整須提早對市場公佈。

## 7、 信息披露

為保證指數的客觀性、中立性和權威性，建立嚴格的資訊披露制度，確保指數的透明、公開和公平。

- 任何資訊在公開披露之前，任何人包括工作人員不得私自向外界公開，不得私自接受媒體採訪。
- 資訊披露的媒體包括但不限於中證指數有限公司網站及中華證券交易服務有限公司網站。
- 樣本股的定期審核結果一般提前兩周公佈；樣本股臨時調整方案盡可能提前公佈；指數編制和維護規則的重大調整一般提前兩周公佈。

## 聯繫我們

欲瞭解更多詳情，請聯絡：

### 指數授權

**中華證券交易服務有限公司**

香港中環康樂廣場八號交易廣場二期 9 樓 906-908 室

電話：852 2803 8200

傳真：852 2868 3770

電郵：cescinfo@cesc.com

網站：<http://www.cesc.com/>

### 客戶服務

**中證指數有限公司(指數服務委託商)**

中國上海市浦東新區錦康路 308 號陸家嘴世紀金融廣場 6 號  
樓 13 層 (郵編：200127)

電話：0086 21 5018 5500

傳真：0086 21 5018 6368

電郵：csindex@sse.com.cn

網站：<http://www.csindex.com.cn/>