



中華證券交易服務有限公司

CHINA EXCHANGES SERVICES
COMPANY LIMITED

中华港股通

优选 50 指数编制方案

2018 年 1 月 4 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	6
6、 指数规则的修订和补充	6
7、 信息披露	7
联系我们	8

引言

中华港股通优选 50 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。

中华港股通优选 50 指数(中华港股通优选 50)为股票价格指数, 旨在反映“港股通股票”内, 于香港联合交易所上市市值首五十名蓝筹股之表现。

指数简称	发布日	样本股
中华港股通 优选 50	04-01-2018	从“港股通”合资格名单内, 选取市值排名首 50 的股票。

1、 指数名称与代码

指数名称：中华港股通优选 50 指数

中文简称：中华港股通优选 50

英文全称：CES Stock Connect Hong Kong Premier 50 Index

英文简称：CES SCHK50

价格指数代码：CESP50（港币） / CES009（人民币）

全收益指数代码：CESP209（港币） / CES109（人民币）

2、 指数基日与基点

该指数以 2011 年 12 月 30 日为基日，以 2000 点为基点。

3、 样本选取方法

3.1 样本空间

中华港股通优选 50 的样本空间为“港股通”合资格股票。

上海证券交易所、深圳证券交易所和香港联合交易所可不时更新后通知市场有关“港股通”合资格股票名单。

3.2 选样方法

中华港股通优选 50 的样本股按照以下方法选择：

- 关联方甄选：剔除中国人民保险集团及其年报披露之上市关联方公司；

- 上市交易时间甄选：剔除上市交易时间不足两年之公司；
- 盈利甄选：剔除年报最近一年财政年度每股盈利（EPS）小于 0 之公司；
- 波动率甄选：剔除剩余样本股过去 12 个月每日回报之年化标准偏差最高 3% 的股票。
- 流通量甄选：剩余样本股按过去 12 个月日均成交金额由高至低排名，并按排名次序优先保留，直至累计日均成交金额达到 90%；
- 自由流通市值甄选：剩余样本股按照过去 12 个月日均自由流通市值由高至低排名，选取前 50 名作为指数样本。详情参见计算与维护细则处理。

以上的甄选准则，在指数整体代表性受到影响时，有关的甄选规则将被适当调整，以确保指数能维持其代表性。

4、 指数计算

中华港股通优选 50 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 × 调整股本数 × 汇率 × 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。在中华港股通优选 50 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%。汇率来自中证指数有限公司不时指定的数据供应商所提供的汇率报价。

5、 指数样本权重调整

5.1 定期调整

中华港股通优选 50 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。样本调整设置缓冲区，排名在前 40 名的新样本优先进入，排名在前 60 名的老样本优先保留。

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。

中华港股通优选 50 不设备选名单。

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，将对中华港股通优选 50 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。

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一周公布；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

有关中华港股通优选 50 和基本规则的详尽数据，欢迎联络中华证券交易服务有限公司的指数服务委托商(中证指数有限公司)。

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/>

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/>