

# 国证 GTCOM 港股通 100 指数编制方案

(2019 年 7 月)

为反映大数据选股策略的市场表现，展现“港股通”优质股票的运行特征，促进指数化投资发展和创新，编制国证 GTCOM 港股通 100 指数。指数包括纯价格指数和全收益指数，分别以人民币和港币计价。

## 一、 代码与名称

指数名称：国证 GTCOM 港股通 100 指数

指数简称：GTCOM 港股通 100

英文名称：CNI GTCOM HK Connect 100 Index

英文简称：GTCOM HK Connect 100

指数代码：980005

指数名称：国证 GTCOM 港股通 100 指数（港币）

指数简称：GTCOM 港股通 100（港币）

英文名称：CNI GTCOM HK Connect 100 Index（HKD）

英文简称：GTCOM HK Connect 100（HKD）

指数代码：980006

## 二、 选样基日与基点

指数基日为 2015 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

## 三、 选样空间

1. “深港通”业务下的港股通所有入围股票；
2. 自上市以来累计半年有交易历史的企业，对于市值排名位于前 20 的股票不受此限制；
3. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
4. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
5. 考察阶段内股价无异常波动；
6. 上市公司最近半年在新闻或者社交媒体中有累计历史报道和披露。

## 四、 选样方法

首先，在入围股票中根据个股成交金额及半年交易天数设置筛选门槛，以具有一定市场活跃度的股票作为初步样本空间；

然后，在初步样本空间中，评估企业运营及企业价值，考量企业综合竞争能力及价值指标，选取综合排名前 100 的个股作为样本股。

## 五、 指数计算

采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

实时指数

= 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本自由流通量} \times \text{汇率})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本自由流通量} \times \text{上一交易日汇率})}$$

## 六、 样本股调整

### 1. 样本股定期调整方法

指数样本股实施季度定期调整，实施时间定于每季度的第一个交易日。

### 2. 样本股临时调整方法

若“港股通”入围股票清单调整，且剔除的股票为 GTCOM 港股通 100 指数中指数样本股，则指数同步剔除该样本股，产生的样本股空缺由选样空间中排名最高的非样本股补足。