

## 国证港股通科技指数编制方案

为反映港股通科技领域龙头上市公司的运行特征，丰富指数化投资工具，编制国证港股通科技指数。

### 一、代码与名称

指数名称：国证港股通科技指数

指数简称：港股通科技

英文名称：CNI HK Connect Technology Index

英文简称：HKCTECH

指数代码：987008

指数名称：国证港股通科技指数（人民币）

指数简称：港股通科技（人民币）

英文名称：CNI HK Connect Technology Index(CNY)

英文简称：HKCTECH(CNY)

指数代码：987009

### 二、基日与基点

指数基日为 2014 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

### 三、选样空间

在香港交易所上市并满足以下条件的股票：

1. 具备互联互通标的资格；
2. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
3. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
4. 考察期内股价无异常波动；
5. 公司主营业务属于科技相关领域，包括：互联网、电子、通信设备、生物科技、医疗器械、大数据、云服务、智能汽车、人工智能等；
6. 公司近两年营业收入复合增长率大于 10%，或近一年研发费用占营业收入比例大于 5%。

### 四、选样方法

首先，剔除选样空间内最近一年日均成交金额排名位于后 10% 的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近一年日均总市值从高到低排序，选取前 30 只股票作为指数样本股。

### 五、指数计算

指数采用派氏加权法，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

$$\times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本股权重调整”。

## 六、样本股调整

### 1. 样本股定期调整

指数样本股实施季度定期调整，于每年3月、6月、9月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。

每次样本股调整数量不超过样本总数的10%。排名在样本数70%范围内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数130%范围内的原样本股按顺序优先保留。

在确定新入选样本股后，在剩余股票中按总市值从高到低排序，选取样本数量5%的股票作为备选样本股。

### 2. 样本股临时调整

当样本股退市或被调出港股通标的清单时，将其从指数样本中同步调出。产生的样本空缺由备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

## 七、样本股权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本股在每次定期调整时的权重不超过 15%，前五大样本股权重之和不超过 60%。

权重调整因子每年调整 4 次，于样本股定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当样本股名单发生变化时，调整因子进行相应调整。