

指数介绍

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。

指数构建

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

指数历史走势 (2015 年 12 月 31 日-2019 年 6 月 28 日)



收益与波动 (日收益) (2019 年 6 月 28 日)

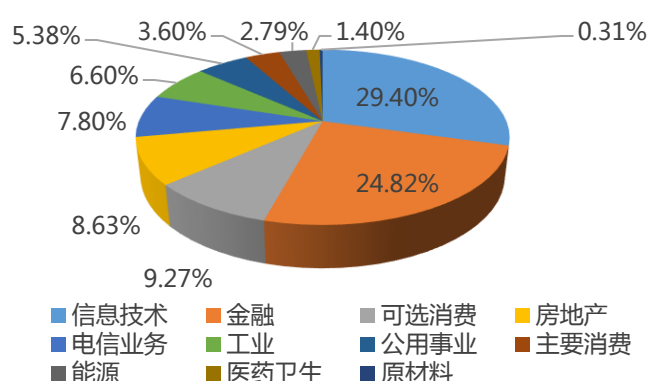
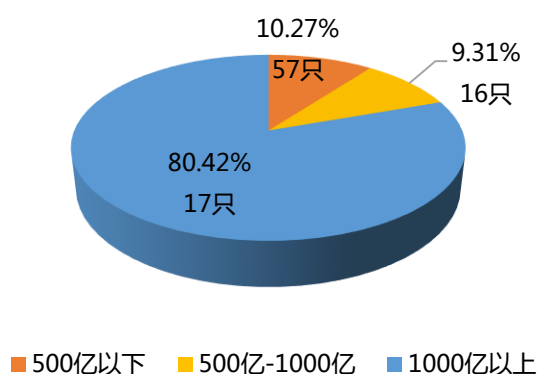
指数	阶段收益				3 年 年化收益	3 年 年化标准差	3 年 夏普比率
	1 个月	3 个月	1 年	今年以来			
GTCOM 港股通 100	5.18%	-2.38%	-1.42%	6.57%	9.11%	16.05%	3.78%

分年度收益

指数	2018	2017	2016
GTCOM 港股通 100	-9.46%	28.37%	2.87%

权重		自由流通市值 (亿元人民币)				
最大样本	最小样本	合计	最大	最小	均值	中位数
5.02%	0.41%	65718.64	18088.38	16.90	657.19	174.02

市值分布 (权重占比, 人民币元) (2019 年 7 月 22 日) 行业分布 (权重占比) (2019 年 7 月 22 日)



十大权重股 (2019 年 7 月 22 日)

代码	简称	行业	权重
00700	腾讯控股	信息技术	27.52%
00941	中国移动	电信业务	5.19%
00005	汇丰控股	金融	15.38%
00883	中国海洋石油	能源	2.79%
00011	恒生银行	金融	1.88%
00388	香港交易所	金融	4.23%
00066	港铁公司	工业	1.08%
02388	中银香港	金融	1.49%
01928	金沙中国有限公司	可选消费	1.31%
00267	中信股份	工业	0.89%
总计			

指数资料

指数简称	GTCOM 港股通 100
英文简称	GTCOM HK Connect 100
指数代码	980005
基日/基点	2005 年 12 月 31 日/1000 点
样本数量	100
发布时间	2019 年 7 月 22 日
调样周期	实施季度定期调整, 实施时间定于每季度的第一个交易日

代码

指数	国证代码	Wind代码
GTCOM港股通100	980005	980005.CNI
GTCOM港股通100 (港币)	980006	980005.CNI

关于我们

深圳证券信息有限公司 (“深证信息”) 是深圳证券交易所 (“深交所”) 全资下属企业, 受深交所委托, 负责 “深证指数” 的规划、研发和运营, 打造以 “深证成指、深证 100、创业板指” 为核心的深市指数体系。深证信息为国内最早开展指数业务的专业化运营机构, 旗下 “国证指数” 致力于建设覆盖全球主要市场的指数体系, 服务各类指数应用需求。

未经深圳证券交易所和深圳证券信息有限公司的授权许可, 任何机构和个人都不得擅自使用 “深证指数” 或 “国证指数” 用作任何商业用途, 包括但不限于用作投资组合的业绩比较基准或者产品的标的指数。以上数据均来源于深圳证券信息有限公司, 仅作为信息参考, 深圳证券信息有限公司力求数据的正确, 但不数据的错误以及由于使用此公开材料所造成的商业损失承担任何责任。指数历史表现并不作为未来收益的保证。

如需更详细的指数信息, 请访问国证指数网 (www.cnindex.com.cn), 电邮 index.service@cninfo.com.cn, 或致电 +86-755 8324 2239