



中華證券交易服務有限公司

CHINA EXCHANGES SERVICES  
COMPANY LIMITED

# 中华交易服务香港生物科技 指数编制方案

2020年12月



# 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

中华交易服务香港生物科技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。

中华交易服务香港生物科技指数(中华香港生物科技)为证券价格指数，旨在反映于香港上市的生物科技公司的整体表现。

指数简称	发布日	指数样本
中华香港生物科技	14-11-2018	香港上市的生物科技公司

## 1、 指数名称与代码

指数名称	指数简称	指数货币	指数代码
中华交易服务香港生物科技指数	中华香港生物科技	港元	CESHKB
中华交易服务香港生物科技指数	中华香港生物科技	人民币	CES010
中华交易服务香港生物科技全收益指数	中华香港生物科技全收益	港元	CES210
中华交易服务香港生物科技全收益指数	中华香港生物科技全收益	人民币	CES110

## 2、 指数基日与基点

该指数以 2014 年 12 月 12 日为基日，以 2000 点为基点。

## 3、 样本选取方法

### 3.1 样本空间

中华香港生物科技的样本空间为在香港交易所主板第一或第二上市的普通证券。

### 3.2 选样方法

中华香港生物科技的样本按照以下方法选择：

- 生物科技行业甄选：符合条件的证券必须根据行业分类划分为“生物科技公司”，或根据《上市规则》第十八 A 章申请上市的生物科技公司；

- 上市时间甄选：剔除上市交易时间不足 3 个月的证券；
- 流动性甄选：剔除过去一年日均成交周转率<sup>^</sup>(每日成交股份数量除以每日上市股份数量)不足 0.05% 且同时过去一年日均成交金额<sup>^</sup>不足 500 万港元的证券；
- 市值甄选：剔除过去一年日均总市值<sup>^</sup>不足 15 亿港元的证券。
- 经上述甄选后，剩余证券按照过去一年日均总市值从高到低排序，选取排名靠前的 30 只证券组成指数样本。剩余证券数量不足 30 只时，全部纳入。

<sup>^</sup>对于上市时间不足一年的证券,日均成交周转率、日均成交金额和日均总市值的考察期均为上市第四个交易日至审核截止日以来。

#### 4、 指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 2000$$

其中，调整市值=∑(证券价格×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。如果指数样本公司为多重上市，则以其公开披露于香港交易所实际交易的股数作为指数权重调整因子的计算依据。

权重调整因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%。然而，当指数样本数量少于 20 只时，单个样本权重上限为 15%。当

样本数量少于 8 只时，单个样本权重上限为 25%。当指数样本数量降至 5 只以下时，指数将采用等权重加权计算，即每只样本在指数中的权重相同。

## 5、 指数样本权重调整

### 5.1 定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五后的下一交易日。

权重调整因子随样本定期调整而调整，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。

### 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，将对中华香港生物科技样本将进行临时调整。发生临时调整时，被剔除的证券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。
- 指数样本的定期审核结果一般提前两周公布；样本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

欲了解更多详情，请联络：

### 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 47 楼 4702-4704 室

电话: 852 2803 8200

传真: 852 2868 3770

电邮: [cescinfo@cesc.com](mailto:cescinfo@cesc.com)

网站: <http://www.cesc.com/>

### 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](mailto:csindex@sse.com.cn)

网站: <http://www.csindex.com.cn/>