

上证港股通指数编制方案

一、 指数名称及代码

中文名称	英文名称	中文简称	英文简称	指数代码
上证港股通指数	SSE HK Equities Index	港股通	HK Equities	H50069

二、 指数基日与基点

上证港股通指数以 2014 年 11 月 14 日为基日,以 3000 点为基点。

三、 样本选取方法

1、 样本空间

港股通范围内的普通股为样本空间。

2、 选样方法

选取样本空间内所有股票作为上证港股通指数样本。

四、 指数计算

上证港股通指数采用派许加权方法,按照样本股的调整股本数为权数进行加权计算,计算公式为:报告期指数=(报告期样本股的调整市值/除数)×3000

其中:调整市值= \sum (股价×调整股本数×汇率), 调整股本数的计

算方法同上证沪股通指数。指数的修正同上证沪股通指数。汇率采用汤森路透综合报价中间价。

五、 指数调整

当港股通范围发生变化时，上证港股通指数样本股进行相应调整。