中華證券交易服務有限公司
CHINA EXCHANGES SERVICES COMPANY LIMITED

中華交易服務港股通泛休閒娛樂指數編制方案

2021 年 3 月

目錄

引言 3
1、 指數名稱與代碼 4
2、 指數基日與基點 4
3、 樣本選取方法 4
4、 指數計算 5
5、 指數樣本調整 5
6、 樣本股權重調整 6
7、 指數規則的修訂和補充 6
8、 信息披露 6
聯繫我們 7

引言

中華交易服務港股通泛休閒娛樂指數(中華港股通泛休閒娛樂)由中華證券交易服務有限公司(中華交易服務)委託深圳證券信息有限公司(深證信息)進行編制，指數編制方案由中華交易服務以及深證信息共同確定。

中華港股通泛休閒娛樂為證券價格指數，旨在反映港股通內領先的休閒娛樂運營商的股價表現。

指數簡稱	發佈日	指數樣本
中華港股通泛休閒娛樂	16-07-2018[1]	港股主板上市及於港股通合資格股票名單內，主要從事休閒娛樂行業的上市公司。

[1]中華港股通泛休閒娛樂指數於 2021 年 3 月 31 日開始以實時計算。

1、 指數名稱與代碼

指數名稱	指數簡稱	指數貨幣	指數代碼
中華交易服務港股通泛休閒娛樂指數	中華港股通泛休閒娛樂	港元	CESPEL
中華交易服務港股通泛休閒娛樂全收益指數	中華港股通泛休閒娛樂全收益	港元	PELHKDG

2、 指數基日與基點

該指數以 2011 年 12 月 30 日為基日，以 2000 點為基點。

3、 樣本選取方法

3.1 樣本空間

中華港股通泛休閒娛樂的樣本空間為港股主板上市及於港股通合資格股票名單內。

上海證券交易所和深圳證券交易所可不時更新後通知市場有關“港股通”合資格證券名單。

3.2 選樣方法

中華港股通泛休閒娛樂的樣本按照以下方法選擇：

- 業務甄選：主要為從事休閒娛樂行業的上市公司，包括：傳媒業務、酒店、餐飲、休閒設施、線上社交平台、電子遊戲和體育產品製造商；
- 市值甄選：剩餘證券按照日均市值^由高至低排名,選取前 30

名作為指數樣本；

^日均市值為證券過去半年的日均市值。

4、 指數計算

指數採用派氏加權法，依據下列公式逐日連鎖實時計算：

$$\text{實時指數} = \text{上一交易日收市指數} \times \frac{\sum(\text{樣本股實時成交價} \times \text{樣本股權數} \times \text{權重調整因子})}{\sum(\text{樣本股上一交易日收市價} \times \text{樣本股權數} \times \text{權重調整因子})}$$

其中，樣本股權數調整方法參見指數計算與維護細則，權重調整因數見“6、樣本股權重調整”。

5、 指數樣本調整

5.1 定期調整

指數樣本股實施半年度定期調整，於每年 6 月和 12 月的第二個星期五的下一個交易日實施。樣本股調整方案通常在實施前兩周公佈。在確定新入選樣本股後，在剩餘股票中按因數權重排名從高到低選取樣本數量 5%的股票作為備選樣本股。

5.2 臨時調整

當樣本股暫停上市、退市或被調出港股通標的清單時，將其從指數樣本中同步調出，選擇備選樣本股名單中排序最靠前的股票補足。

6、 樣本股權重調整

在指數計算時，設置調整因數，使得單只股票權重上限不超過 10%。

權重調整因數每年調整 2 次，於樣本股定期調整時實施。在下一個定期調整日之前，權重調整因數一般固定不變。

7、 指數規則的修訂和補充

根據市場的發展變化和指數用戶的反饋，中華交易服務和深證信息適時將對指數規則進行修訂或補充。指數規則的調整須提早對市場公佈。

8、 信息披露

為保證指數的客觀性、中立性和權威性，建立嚴格的信息披露制度，確保指數的透明、公開和公平。

- 任何信息在公開披露之前，任何人包括工作人員不得私自向外界公開，不得私自接受媒體採訪。
- 信息披露的媒體包括但不限於中華證券交易服務有限公司及深圳證券信息有限公司網站。

聯繫我們

欲了解更多詳情，請聯絡：

指數授權

中華證券交易服務有限公司

香港中環康樂廣場八號交易廣場二期 47 樓 4702-4704 室

電話: 852 2803 8200

傳真: 852 2868 3770

電郵: cescinfo@cesc.com

網站：http://www.cesc.com/

客戶服務

深圳證券信息有限公司(指數服務委託商)

中國廣東省深圳市福田區紅荔西路上步工業區 203 棟

電話: 0086 755 8320 2239

傳真: 0086 755 8324 3723

電郵: index.service@cninfo.com.cn

網站：http://www.cnindex.com.cn/