



## 恒生綜合指數系列

阅读本文件时，建议连同恒生指数有限公司(「恒生指数公司」)于网页上提供的指数编算总则一同阅读。

本文件之使用者须注意，在一些特别情况下，指数处理可能有别于以下的一般做法。恒生指数公司保留决定最合适做法的权利。

此中文版编算方法仅作参考之用。完整的恒生综合指数系列编算方法，请见英文版。

<b>目的</b>	旨在提供一项全面的香港证券市场指标
<b>选股范畴</b>	香港交易所主板上市的证券及预托证券，包括主要业务位于大中华区的第一及第二上市公司、房地产买卖基金及合订证券，以及第一上市一股一票的外国公司； 不包根据香港交易所主板上市规则第 21 章上市之投资公司
<b>候选资格</b>	
<b>上市历史要求</b>	没有
<b>流动性要求</b>	基准指数的换手率测试 (每月换手率为 0.05%或以上，详情请见指数编算总则)
<b>成份股挑选准则</b>	
<b>挑选方法</b>	根据最近12个月月均市值由大至小排列选股范畴内之证券，并计算每只证券的累计市值覆盖率； 累计市值覆盖率于前 95%以内之合资格证券会被选为成份股
<b>成份股数目</b>	非固定
<b>缓冲区</b>	累计市值覆盖率 96%以外的现有成份股将从指数中剔除，累计市值覆盖率 94%以内的证券将加入指数



## 恒生綜合指數系列

### 恒生綜合市值指數

恒生綜合大型股指數、恒生綜合中型股指數及恒生綜合小型股指數目標覆蓋恒生綜合指數成份股累計市值之首 80%、次 15%及末 5%；

採用緩衝區後，市值指數的出入門檻如下：

市值指數 門檻	恒生綜合指數內的累計市值覆蓋率			
	現有成份股			非現有成份股
	大型股	中型股	小型股	
大型股	83%	77%	77%	77%
中型股	97%	97%	93%	93%
小型股	100%	100%	100%	100%

恒生綜合大中型股指數由恒生綜合大型股指數及恒生綜合中型股指數之成份股組成；

恒生綜合中小型股指數由恒生綜合中型股指數及恒生綜合小型股指數之成份股組成

### 恒生綜合行業指數

恒生綜合指數成份股會按恒生行業分類系統配對至以下 12 個行業指數：

代號	一級行業
00	能源業
05	原材料業
10	工業
23	非必需性消費
25	必需性消費
28	醫療保健業
35	電訊業
40	公用事業
50	金融業
60	地產建築業
70	資訊科技業
80	綜合企業



## 恒生綜合指數系列

检讨周期	每半年 (数据截至每年六月底及十二月底)
比重调整周期	每季
快速纳入机制	<p><u>季度</u> 于第一季及第三季上市之证券倘满足恒生综合大型股指数及恒生综合中型股指数的市值要求，将于六月及十二月之指数调整中加入恒生综合指数及其相关指数</p> <p><u>不定时</u> 如新股在首个交易日之收市市值排名，在现有指数成份股中前 10%(指成份股数目)，该新股将被纳入恒生综合指数及其相关指数；</p> <p>新股加入一般于该公司上市后的第 10 个交易日收市后实施</p>
临时剔除成份股之替换	没有
加权方法	流通市值加权
比重上限	每间成份股公司 10% (恒生综合市值指数及恒生综合行业指数之成份股采用与恒生综合指数相同的比重上限系数，不再另行实施比重上限)
货币	港币
指数发布	每隔 2 秒实时发布



## 恒生綜合指數系列

指數	指數代碼			
	路孚特		彭博	
	價格	股息累計	價格	股息累計
綜合指數	.HSCI	.HSCIDV	HSCI	HSI 6
大型股	.HSLI	.HSLIDV	HSLI	HSI 34
中型股	.HSMI	.HSMIDV	HSMI	HSI 35
小型股	.HSSI	.HSSIDV	HSSI	HSI 36
大中型股	.HSLMI	.HSLMIDV	-	-
中小型股	.HSMSI	.HSMSIDV	-	-
能源業	.HSCIE	.HSCIEDV	HSCIEN	HSI 29
原材料業	.HSCIM	.HSCIMDV	HSCIMT	HSI 30
工業	.HSCIIG	.HSCIIGDV	HSCIIN	HSI 8
非必需性消費	.HSCICD	.HSCICDT	HSCICD	HSCICDT
必需性消費	.HSCICS	.HSCICST	HSCICS	HSCICST
醫療保健業	.HSCIH	.HSCIHT	HSCIH	HSCIHT
電訊業	.HSCIT	.HSCITDV	HSCITC	HSI 31
公用事業	.HSCIU	.HSCIUDV	HSCIUT	HSI 11
金融業	.HSCIF	.HSCIFDV	HSCIFN	HSI 12
地產建築業	.HSCIPC	.HSCIPCDV	HSCIPC	HSI 13
資訊科技業	.HSCIIT	.HSCIITDV	HSCIIT	HSI 14
綜合企業	.HSCIC	.HSCICDV	HSCICO	HSI 15

有關本檔的專有名詞及計算方法詳情，請參閱恒生指數公司網頁上的指數編算總則。



## 修改纪录

	日期	简述
2.1	2021 年 3 月	中文版首刊
2.2	2023 年 1 月	(英文版) 取消对第二上市公司股本数目之特殊处理方法 ( 2022 年 12 月指数检讨开始生效 )
2.3	2024 年 1 月	厘清香港上市预托证券的指数候选资格

### 声明

所有于此文件所载之数据仅供参考之用。恒生指数有限公司 (「恒生指数公司」) 致力确保于此文件所载之数据属准确及可靠，惟恒生指数公司并不作出任何声明或保证该等数据的准确性、完整性或可依赖性。任何人士因依赖此档之任何内容，或因此文件所载任何数据之错误或遗漏而引致任何损害或损失，恒生指数公司概不承担任何责任 ( 不论是民事侵权行为责任或合约责任或其他 )。此档内容可不时作出更新而毋须另行通知。

所有于此文件所载之资料或内容均不代表恒生指数公司对任何投资作出明示或暗示的建议或推介。投资涉及风险，任何人士如有投资之需求，应根据其本身的投资目的、财务状况及独特需要作出决定，并咨询独立投资意见。

© 恒生指数有限公司 2024。版权所有。