

新华沪港深新兴消费品牌指数编制方案

(2020 年 12 月)

新华沪港深新兴消费品牌指数从沪港深三地市场中，选取涉及新兴消费领域，即在商业模式上涉及新消费人群、消费理念、新消费品种类、新消费场景，面向消费者提供终端产品、服务兼具品牌影响力的上市公司作为样本空间，以反映代表新兴消费业态的上市公司的整体表现。

新兴消费领域的公司其主营业务涉及消费电子、新能源汽车消费互联网、智能家居、新零售、潮流服饰、文娱 IP、医美保健、休闲食品、母婴消费、宠物经济及未来其他新兴消费行业。

一、 指数名称和代码

指数名称：新华沪港深新兴消费品牌指数

指数简称：新华SHS 新兴消费

英文名称：XH·SH-HK-SZ Emerging Consumption Brands
Index

英文简称：XH·SHS Emerging Consumption

指数代码：989006

二、 指数基日和基点

该指数以 2016 年 12 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、 样本选取方法

1. 样本空间

在A股、港股（港股通标的）市场上市，选取满足以下条件的股票组成样本空间：

- 1) 上市公司主营业务覆盖以下范围：消费电子、新能源汽车、消费互联网、智能家居、新零售、潮流服饰、文娱IP、医美保健、休闲食品、母婴消费、宠物经济及未来其他新兴消费行业；
- 2) 上市时间超过一年；
- 3) 成分证券最近一年日均成交金额位于其所在证券交易所全部上市股票的前 80%；
- 4) 非 ST、*ST 股票；
- 5) 公司近一年无重大违规、财务报告无重大问题；

- 6) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
- 7) 考察期内股价无异常波动；
- 8) 非长期停牌股票。

2. 选样方法

在剩余的股票中，根据新华指数品牌价值体系综合得分，筛选排名靠前的 50 只股票作为成分股。若同一家公司的沪深市场股票和香港市场股票同时入选，则优先纳入沪深市场股票。

四、 指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum \text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子}}{\sum \text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子}}$$

权重调整因子按自由流通市值进行加权，其中个股权重不超过 10%，详见“五、指数样本和权重调整”。

五、 指数样本和权重调整

1. 定期调整

该指数每半年进行样本调整，调整生效日期为每年 6 月和 12 月的第二个星期五后的下一个交易日。每次调整的样本比例一般不超过 20%，除非因不满足样本空间条件被剔除的原样本超过了 20%。

样本设置缓冲区，排名在 35 名内的新样本优先进入指数，排名在 65 名之前的老样本优先保留。

2. 临时调整

特殊情况下将对指数样本进行调整。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照相关方法进行处理。

当出现样本股临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，新进指数的股票一般情况下将继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的收盘权重，并据此计算新进股票的权重因子。

六、 免责声明

新华沪港深新兴消费品牌指数属于新华指数（北京）有限公司所有，未经书面许可，任何单位和个人不得跟踪、交易该指数，或以指数为评价基准。对任何直接或间接使用本文件及任何信息

而造成的损失，包 但不限于因内容不准确、不完整而导致的损失，新华指数（北京）有限公司及其关联方无须承担任何法律责任。