

# 中证 100 指数编制方案

中证 100 指数从沪深市场中选取 100 只市值较大、流动性较好且具有行业代表性的上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场核心龙头上市公司证券的整体表现。

## 一、指数名称和代码

指数名称：中证 100 指数

指数简称：中证 100

英文名称：CSI 100 Index

英文简称：CSI 100

指数代码：000903/399903

## 二、指数基日和基点

该指数以 2005 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

同中证全指指数的样本空间

### 2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

### 3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，剔除中证 ESG 评价结

果在 C 及以下的上市公司证券;

(2) 在剩余证券中, 选取总市值位于样本空间前 300 名且属于沪股通或深股通证券范围的上市公司证券作为待选样本;

(3) 在待选样本中, 优先选取二级行业自由流通市值最大且总市值位于样本空间前 100 名的上市公司证券作为指数样本;

(4) 在剩余待选样本中, 从各一级行业内按照自由流通市值由高到低依次选入一定数量的证券, 以使样本数量达到 100 只, 且各一级行业自由流通市值占比与样本空间尽可能保持一致。具体做法如下:

计算指数样本各一级行业自由流通市值占比, 选出相较样本空间对应行业自由流通市值占比最低的行业; 从剩余待选样本中, 选择该行业自由流通市值最大的证券作为指数样本; 重复该步骤, 直至样本数量达 100 只。

#### 四、指数计算

指数计算公式为:

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中, 调整市值 =  $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间, 以使单个样本权重不超过 10%。

#### 五、指数样本和权重调整

##### 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为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重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，权重因子一般固定不变。每次调整的样本比例一般不超过 20%。定期调整设置缓冲区，根据选样方法第（4）步得到全部剩余待选样本入选顺序，入选顺序在 80 名之前的新样本优先进入，入选顺序在 120 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进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当沪股通或深股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时，指数将相应调整。