

中证 800 行业指数系列编制方案

为反映中证 800 指数样本中不同行业公司证券的整体表现,为投资者提供分析工具,将中证 800 指数样本按中证行业分类分为 11 个一级行业与 35 个二级行业,再以进入各一、二级行业的全部证券作为样本编制指数,形成中证 800 行业指数。

一、指数名称和代码

见附录

二、指数基日和基点

见附录

三、样本选取方法

1、样本空间

中证 800 指数样本

2、选样方法

将样本空间证券按中证行业分类方法分类,进入各一级、二级行业的全部证券形成相应中证 800 行业指数的样本。

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。各指数单个样本权重上限详见附录。

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。

2、临时调整

当中证 800 指数调整样本时，中证 800 行业指数样本随之进行相应调整。在样本公司有特殊事件发生，导致其行业归属发生变更时，将对中证 800 行业指数样本进行相应调整。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。

附录：中证 800 行业指数名称、代码、基日、基点与单个样本权重上限

| 一级行业指数名称 | 指数简称 | 指数代码 | 基日 | 基点 | 单个样本权重上限 |
|-------------|--------|---------------|------------|------|----------|
| 中证能源指数 | 800 能源 | 000928/399928 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证原材料指数 | 800 材料 | 000929/399929 | 2004-12-31 | 1000 | 无 |
| 中证工业指数 | 800 工业 | 000930/399930 | 2004-12-31 | 1000 | 无 |
| 中证可选消费指数 | 800 可选 | 000931/399931 | 2004-12-31 | 1000 | 10% |
| 中证主要消费指数 | 800 消费 | 000932/399932 | 2004-12-31 | 1000 | 10% |
| 中证医药卫生指数 | 800 医卫 | 000933/399933 | 2004-12-31 | 1000 | 10% |
| 中证 800 金融指数 | 800 金融 | H30086/000974 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 地产指数 | 800 地产 | 399965 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证信息技术指数 | 800 信息 | 000935/399935 | 2004-12-31 | 1000 | 无 |
| 中证通信服务指数 | 800 通信 | 000936/399936 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证公用事业指数 | 800 公用 | 000937/399937 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |

| 二级行业指数名称 | 指数简称 | 指数代码 | 基日 | 基点 | 单个样本权重上限 |
|------------------|------------|--------|------------|------|----------|
| 中证 800 能源指数 | 800 能源(二级) | H30010 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 商业服务与用品指数 | 800 商业 | H30013 | 2004-12-31 | 1000 | 无 |
| 中证 800 运输指数 | 800 运输 | H30014 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 耐用消费品指数 | 800 耐用 | H30016 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 消费者服务指数 | 800 服务 | H30017 | 2004-12-31 | 1000 | 无 |
| 中证 800 传媒指数 | 800 传媒 | H30018 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 零售业指数 | 800 零售 | H30019 | 2004-12-31 | 1000 | 无 |
| 中证 800 食品饮料指数 | 800 食品 | H30020 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 银行指数 | 800 银行 | H30022 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 资本市场指数 | 800 资本 | H30023 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 保险指数 | 800 保险 | H30024 | 2007-12-31 | 1000 | 无 |
| 中证 800 计算机指数 | 800 计算机 | H30026 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 半导体指数 | 800 半导 | H30028 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |

| | | | | | |
|--------------------|----------|--------|------------|------|-----|
| 中证 800 通信设备及技术服务指数 | 800 通信设备 | H30029 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 有色金属指数 | 800 有色 | H30031 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |
| 中证 800 制药与生物科技指数 | 800 医药 | 000841 | 2004-12-31 | 1000 | 15% |