

## 中证内地主题系列指数编制方案

中证内地主题系列指数包括中证内地消费主题指数、中证内地资源主题指数、中证内地运输主题指数、中证内地银行主题指数、中证内地地产主题指数等指数，以反映沪深市场各重要主题类上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

| 指数名称       | 指数简称 | 英文名称                                      | 英文简称              | 指数代码          |
|------------|------|---|-------------------|---------------|
| 中证内地消费主题指数 | 内地消费 | CSI China Mainland Consumer Index         | CN Consumer       | 000942/399942 |
| 中证内地资源主题指数 | 内地资源 | CSI China Mainland Natural Resource Index | CN Resource       | 000944/399944 |
| 中证内地运输主题指数 | 内地运输 | CSI China Mainland Transportation Index   | CN Transportation | 000945/399945 |
| 中证内地银行主题指数 | 内地银行 | CSI China Mainland Banks Index            | CN Banks          | 000947/399947 |
| 中证内地地产主题指数 | 内地地产 | CSI China Mainland Real Estate Index      | CN Real Estate    | 000948/399948 |

### 二、指数基日和基点

该指数系列以2004年12月31日为基日，基点1000。

### 三、样本选取方法

#### 1、样本空间

中证 800 指数样本

## 2、选样方法

(1) 进行主题证券筛选：

| 主题 | 包含行业  |
|----|---|
| 资源 | 综合性石油与天然气企业<br>燃油炼制<br>天然气加工<br>煤炭<br>有色金属<br>其他非金属材料 |
| 运输 | 交通运输  |
| 消费 | 可选消费<br>主要消费  |
| 银行 | 银行  |
| 地产 | 房地产   |

(2) 选取各主题类别中过去一年日均市值由高到低排名前 50 的证券作为相纳入应主题指数样本，若主题类证券数量少于 50 只，则将其全部纳入相应主题指数。

## 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 15%。

## 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，指数样本随之进行相应调整。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。