

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 燃油炼制 天然气加工 煤炭 有色金属 其他非金属材料
运输	交通运输
消费	可选消费 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。