

中证全指行业优选指数系列编制方案

中证全指行业优选指数系列从中证全指对应行业中选取符合一定流动性与市值筛选条件的上市公司作为指数样本，以反映各个行业内较具代表性与可投资性的上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

见附件

二、指数基日和基点

见附件

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、选样方法

(1) 将样本空间证券按中证行业分类方法分类；

(2) 如果行业内证券数量少于或等于 50 只，则全部证券作为相应全指行业指数的样本；

(3) 如果行业内证券数量多于 50 只，则依次剔除行业内全部证券成交金额排名后 10%的证券以及累积总市值占比达行业内全部证券 70%以后的证券，剔除过程中优先确保剩余证券数量不少于 50 只，将剩余证券作为相应行业指数的样本。

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。权重因子介于 0 和 1 之间，单个样本权重不超过 15%，前五大样本权重合计不超过 60%。

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

当中证全指指数调整样本时，中证全指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，将对中证全指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：中证全指行业优选指数名称、代码、基日、基点

| 一级行业指数名称 | 指数简称 | 指数代码 | 基日 | 基点 |
|------------|------|--------|------------|------|
| 中证全指能源指数 | 全指能源 | 000986 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指原材料指数 | 全指材料 | 000987 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指工业指数 | 全指工业 | 000988 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指可选消费指数 | 全指可选 | 000989 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指主要消费指数 | 全指消费 | 000990 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指医药卫生指数 | 全指医药 | 000991 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指信息技术指数 | 全指信息 | 000993 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指通信服务指数 | 全指通信 | 000994 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指金融指数 | 全指金融 | 932075 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指地产指数 | 全指地产 | 932076 | 2004-12-31 | 1000 |
| 中证全指公用事业指数 | 全指公用 | 000995 | 2004-12-31 | 1000 |

| 二级行业指数名称 | 指数简称 | 指数代码 | 基日 | 基点 |
|-----------------|-----------|--------|------------|------|
| 中证全指化工行业指数 | 化工行业 | 932111 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指有色金属行业指数 | 有色金属行业 | 932112 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指钢铁行业指数 | 钢铁行业 | 932113 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指非金属材料行业指数 | 非金属材料行业 | 932114 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指造纸与包装行业指数 | 造纸与包装行业 | 932115 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指航空航天与国防行业指数 | 航空航天与国防行业 | 932116 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指建筑装饰行业指数 | 建筑装饰行业 | 932117 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指电力设备行业指数 | 电力设备行业 | 932118 | 2021-12-31 | 1000 |

| 二级行业指数名称 | 指数简称 | 指数代码 | 基日 | 基点 |
|-------------------|----------|--------|------------|------|
| 中证全指机械制造行业指数 | 机械制造行业 | 932119 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指环保行业指数 | 环保行业 | 932120 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指商业服务与用品行业指数 | 商业服务行业 | 932121 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指交通运输行业指数 | 交通运输行业 | 932122 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指乘用车及零部件行业指数 | 汽车汽配行业 | 932123 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指耐用消费品行业指数 | 耐用消费品行业 | 932124 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指纺织服装与珠宝行业指数 | 服装珠宝行业 | 932125 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指消费者服务行业指数 | 消费者服务行业 | 932126 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指零售业行业指数 | 零售行业 | 932127 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指食品、饮料与烟草行业指数 | 食品饮料烟草行业 | 932128 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指农牧渔行业指数 | 农牧渔行业 | 932129 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指家庭与个人用品行业指数 | 家庭用品行业 | 932130 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指医疗行业指数 | 医疗行业 | 932131 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指医药行业指数 | 医药行业 | 932132 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指银行行业指数 | 银行行业 | 932133 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指电信服务行业指数 | 电信服务行业 | 932140 | 2021-12-31 | 1000 |
| 中证全指通信设备及技术服务行业指数 | 通信设服行业 | 932141 | 2021-12-31 | 1000 |