

中证新华社民族品牌工程指数编制方案

中证新华社民族品牌工程指数从新华社民族品牌工程入选名单和遴选名单中的选取不超过 100 只消费、医药和科技板块的上市公司证券作为指数样本，以反映入选新华社民族品牌工程的上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证新华社民族品牌工程指数

指数简称：品牌工程

英文名称：CSI National Brands Project of Xinhua Index

英文简称：National Brands Index

指数代码：931403

二、指数基日和基点

该指数以 2017 年 8 月 25 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

流动性要求：过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 80%；

盈利要求：净利润不得连续两年为负。

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，按照过去一年日均总市值由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 在剩余证券中，选取新华社民族品牌工程入选名单和遴选名单中的消费、医药和科技板块的上市公司证券作为待选样本；

(3) 对上述待选样本，按照过去一年日均总市值由高到低排序，选取排名靠前的 100 只证券作为指数样本，不足 100 只时，全部纳入指数。

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 10%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每季度调整一次，样本调整实施时间分别为每年 3 月、6 月、9 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

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。