

## 中证一带一路主题指数编制方案

中证一带一路主题指数在综合考虑过去一年日均总市值、现有海外业务占比、新签一带一路地区订单、主营业务所在地域等四个维度的基础上，从基础设施建设、交通运输、高端装备、电力通信、资源开发等五大产业中选取较具主题代表性的上市公司证券作为指数样本，以反映一带一路主题上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证一带一路主题指数

指数简称：一带一路

英文名称：CSI One Belt & One Road Index

英文简称：CSI OBOR

指数代码：399991

### 二、指数基日和基点

该指数以 2012 年 12 月 31 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、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 10% 的证券；

(2) 对样本空间内剩余证券，将一带一路主题划分为五大相关产业，分别为：基础建设、交通运输、高端装备、电力通信、资源开发；

(3) 在每个产业中，在综合考虑过去一年日均总市值、现有海外业务占比、新签一带一路地区订单、主营业务所在地域等四个维度的基础上，选取较具主题代表性的证券作为指数样本，并确保每个产业入选的证券总数不超过 20 只。

#### 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 3%。

#### 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。每次调整的样本比例一般不超过 20%。

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。