

中证方正富邦保险主题指数编制方案

中证方正富邦保险主题指数从沪深市场中选取 20 只保险行业与参股保险类上市公司证券作为指数样本，以反映保险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：中证方正富邦保险主题指数

指数简称：保险主题

英文名称：CSI Founder Fubon Insurance Theme Index

英文简称：Insurance Theme

指数代码：399809

二、指数基日和基点

该指数以 2011 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、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%。

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，根据中证行业分类，若保险行业证券数量多于 20 只，按照过去一年日均总市值由高到低排名选择前 20 只作为指数样本；

(2) 若保险行业证券数量不足 20 只，则先将保险行业证券作为指数样本，然后将参股保险公司金额大于 1 亿的上市公司，依照参股比例由高到低依次纳入，直到样本数量达到 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，以使保险行业权重为 75%，参股保险类权重为 25%；并且单个保险行业样本权重不超过 30%，单个参股保险类样本权重不超过 3%。保险行业权重设置将随保险行业样本数量变化而变化，保险行业样本数量每增加 1 只，保险行业权重增加 1.56%，参股保险类权重进行相应减少。

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

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。