

## 中证 800 证券保险指数编制方案

中证 800 证券保险指数是在中证 800 指数的基础上,选择证券保险行业内对应的证券作为指数样本,为投资者提供更多样化的投资标的。

### 一、指数名称和代码

指数名称: 中证 800 证券保险指数

指数简称: 800 证保

英文名称: CSI 800 Financials(ex Banks) Index

英文简称: 800 Fin(ex Banks)

指数代码: 399966

### 二、指数基日和基点

该指数系列以 2004 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

中证 800 指数样本

#### 2、选样方法

将样本空间内归属于保险、证券公司的上市公司证券纳入指数。

## 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 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

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。