

## 中证建设工程指数编制方案

中证建设工程指数从沪深市场中选取建筑与工程、建筑装饰行业的上市公司证券作为指数样本，以反映建设工程领域相关上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证建设工程指数

指数简称：建设工程

英文名称：CSI Construction & Engineering Index

英文简称：Const-Engineering

指数代码：399995

### 二、指数基日和基点

该指数以 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

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 20%的证券；

(2) 对样本空间内剩余证券选取建筑与工程、建筑装饰行业的上市公司证券纳入建设工程主题；

(3) 将(2)中剩余证券按照过去一年日均总市值由高到低排名,选取排名前50的证券作为指数样本。

#### 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,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。