

## 中证消费龙头指数编制方案

中证消费龙头指数从沪深市场的可选消费与主要消费等行业中选取规模大、经营质量好的 50 只上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场消费龙头上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证消费龙头指数

指数简称：消费龙头

英文名称：CSI Consumer Top Index

英文简称：CSI Consumer Top

指数代码：931068

### 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) 将样本空间中属于可选消费与主要消费等行业的证券作为待选样本；

(2) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值、营业收入 (TTM)、ROE (TTM) 与毛利率 (TTM) 四个指标分别由高到低排名，将四项排名的算术平

均由低到高排名作为综合排名；

(3) 将上述待选样本划分至纺织服装、休闲服务、食品等细分行业，根据各细分行业内剩余样本数量占比，分配各行业的最终入选样本数量。在每个细分行业内，选取综合排名高的证券作为指数样本，确保指数样本数量为 50 只。

#### 四、指数计算

指数的计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

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%，前五大样本权重合计不超过 60%。

#### 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。