

中证回购指数编制方案

中证回购指数从沪深市场选取回购比例较高的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场高回购比例证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证回购指数

指数简称：中证回购

英文名称：CSI Buyback Index

英文简称：CSI Buyback

指数代码：931829

二、指数基日和基点

该指数以2018年12月28日为基日，以1000点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

同中证全指指数样本空间

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额位于样本空间前 80%。

3、选样方法

对于样本空间中满足可投资性筛选条件的证券，按照回购比例由高到低排名，选取排名靠前的 100 只证券作为指数样本。

其中，回购比例 = $\frac{\text{过去一年回购金额}}{\text{过去一年日均总市值}}$ 。

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，以使样本采用回购比例加权，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

指数样本每季度调整一次，样本调整实施时间分别为每年 3、6、9、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。