

中证证券保险指数编制方案

中证证券保险指数从沪深市场中选取归属于保险、证券公司行业的上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场证券与保险行业上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证证券保险指数

指数简称：中证证保

英文名称：CSI Securities and Insurance Index

英文简称：Securities and Insurance

指数代码：H30588

二、指数基日和基点

该指数以 2009 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，选取归属于保险、证券公司行业的上市公司证券作为待选样本；

(3) 将上述待选样本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 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。