

中证 200、中证 500、中证 700 和中证 800 指数编制方案

中证系列规模指数分别反映沪深市场内不同市值规模上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
中证中盘 200 指数	中证 200	CSI Midcap 200 Index	CSI 200	000904/399904
中证小盘 500 指数	中证 500	CSI Smallcap 500 Index	CSI 500	000905/399905
中证中小盘 700 指数	中证 700	CSI Small&Midcap 700 Index	CSI 700	000907/399907
中证 800 指数	中证 800	CSI 800 Index	CSI 800	000906

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

同沪深 300 指数的样本空间

2、选样方法

(1) 中证 200 指数

选取沪深 300 指数样本中剔除中证 100 指数样本后剩余的 200 只证券作为指数样本。

(2) 中证 500 指数

(2.1) 在样本空间中剔除沪深 300 指数样本以及过去一年日均总市值排名前 300 的证券;

(2.2) 对样本空间内剩余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;

(2.3) 将剩余证券按照过去一年日均总市值由高到低进行排名, 选取排名前 500 的证券作为指数样本。

(3) 中证 700 指数

中证 500 和中证 200 指数样本一起作为指数样本。

(4) 中证 800 指数

中证 500 和沪深 300 指数样本一起作为指数样本。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数})$ 。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。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

中证 500 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。每次调整的样本比例一般不超过 10%。定

期调整设置缓冲区，日均成交金额排名在样本空间的剩余证券（剔除沪深 300 指数样本及过去一年日均总市值排名前 300 名的证券后）前 90% 的老样本可参与下一步日均总市值排名；日均总市值排名在 400 名之前的新样本优先进入，排名在 600 名之前的老样本优先保留。定期调整时设置备选名单，备选名单中证券数量一般为指数样本数量的 5%。

2、临时调整

特殊情况下将对中证 500 指数进行临时调整，当发生临时调整时，由最近一次指数定期调整时备选名单中排名最高的证券替代被剔除的证券。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。当沪深 300、中证 100、中证 500 指数调整样本时，中证 200、中证 700 和中证 800 指数随之进行相应的调整。