

中证全指行业指数编制方案

为反映中证全指指数样本中不同行业公司证券的整体表现,为投资者提供分析工具,将中证全指指数样本按中证行业分类分为 11 个一级行业、35 个二级行业、90 余个三级行业及 200 余个四级行业,再以进入各一、二、三、四级行业的全部证券作为样本编制指数,形成中证全指行业指数。

一、指数名称和代码

见附录

二、指数基日和基点

见附录

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) 将样本空间证券按中证行业分类方法分类;

(2) 如果行业内证券数量少于或等于 50 只,则全部证券作为相应全指行业指数的样本;

(3) 如果行业内证券数量多于 50 只,则依次剔除行业内全部证券成交金额排名后 10%的证券以及累积总市值占比达行业内全部证券 98%以后的证券,剔除过程中优先确保剩余证券数量不少于 50 只,将剩余证券作为相应行业指数的

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。各指数单个样本权重上限详见附录。

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

当中证全指指数调整样本时，中证全指行业指数样本随之进行相应调整。在样本公司有特殊事件发生，导致其行业归属发生变更时，将对中证全指行业指数样本进行相应调整。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。

附录：中证全指行业指数名称、代码、基日、基点与单个样本权重上限

一级行业指数名称	指数简称	指数代码	基日	基点	单个样本权重上限
中证全指能源指数	全指能源	000986	2004-12-31	1000	10%
中证全指原材料指数	全指材料	000987	2004-12-31	1000	10%
中证全指工业指数	全指工业	000988	2004-12-31	1000	10%
中证全指可选消费指数	全指可选	000989	2004-12-31	1000	10%
中证全指主要消费指数	全指消费	000990	2004-12-31	1000	10%
中证全指医药卫生指数	全指医药	000991	2004-12-31	1000	10%
中证全指金融指数	全指金融	931824	2007-12-28	1000	10%
中证全指房地产指数	房地产	931775	2004-12-31	1000	10%
中证全指信息技术指数	全指信息	000993	2004-12-31	1000	10%
中证全指通信服务指数	全指通信	000994	2004-12-31	1000	10%
中证全指公用事业指数	全指公用	000995	2004-12-31	1000	10%

二级行业指数名称	指数简称	指数代码	基日	基点	单个样本权重上限
中证银行指数	中证银行	399986	2004-12-31	1000	15%
中证全指农牧渔指数	农牧渔	930910	2004-12-31	1000	15%
中证全指乘用车及零部件指数	汽车汽配	H30164	2004-12-31	1000	10%
中证全指机械制造指数	机械制造	H30166	2004-12-31	1000	10%
中证全指商业服务与商业用品指数	商业指数	H30170	2004-12-31	1000	10%
中证全指运输指数	运输指数	H30171	2004-12-31	1000	10%
中证全指消费者服务指数	消费者	H30173	2004-12-31	1000	15%
中证全指媒体指数	媒体指数	H30174	2004-12-31	1000	10%
中证全指零售业指数	零售指数	H30175	2004-12-31	1000	10%
中证全指食品、饮料与烟草指数	全指食品	H30177	2004-12-31	1000	10%
中证全指医药指数	制药生物	H30179	2004-12-31	1000	10%
中证全指计算机指数	计算机	H30182	2004-12-31	1000	10%
中证全指电子指数	电子	H30183	2004-12-31	1000	10%
中证全指半导体产品与设备指数	半导体	H30184	2004-12-31	1000	15%
中证全指保险指数	保险指数	H30186	2007-06-30	1000	无
中证全指化工指数	全指化工	H30187	2004-12-31	1000	10%
中证全指有色金属指数	有色金属	H30191	2004-12-31	1000	10%
中证全指耐用消费品指数	耐用消费品	H30196	2004-12-31	1000	10%
中证全指资本市场指数	资本市场	H30211	2007-06-30	1000	10%

三级行业指数名称	指数简称	指数代码	基日	基点	单个样本权重上限
中证全指家用电器指数	家用电器	930697	2004-12-31	1000	15%
中证全指化学原料指数	化学原料	930911	2004-12-31	1000	10%
中证全指食品指数	食品	H30192	2004-12-31	1000	10%
中证全指纺织服装指数	纺织服装	H30193	2004-12-31	1000	10%
中证全指汽车零配件指数	汽车配件	H30194	2004-12-31	1000	10%
中证全指建筑与工程指数	建筑工程	H30195	2004-12-31	1000	10%
中证全指一般零售指数	一般零售	H30197	2004-12-31	1000	15%
中证全指电力公用事业指数	电力指数	H30199	2004-12-31	1000	10%
中证全指交通基础设施指数	交通设施	H30200	2004-12-31	1000	15%
中证全指信息技术服务指数	信息服务	H30203	2004-12-31	1000	10%
中证全指休闲服务指数	休闲服务	H30204	2004-12-31	1000	15%
中证全指纸类与林业产品指数	纸类林业	H30206	2004-12-31	1000	15%
中证全指专营零售指数	专营零售	H30208	2004-12-31	1000	15%
中证全指建筑产品指数	建筑产品	H30209	2004-12-31	1000	15%
中证全指生物药品指数	生物药品	H30212	2004-12-31	1000	15%
中证全指油气开采与油田服务指数	油气开采服务	H30214	2004-12-31	1000	15%
中证全指休闲设备与用品指数	休闲用品	H30215	2004-12-31	1000	15%
中证全指医疗器械指数	医疗器械	H30217	2004-12-31	1000	15%
中证全指水公用事业指数	水务指数	H30218	2004-12-31	1000	15%
中证全指容器与包装指数	容器包装	H30219	2004-12-31	1000	15%
中证全指文化娱乐指数	文化娱乐	H30220	2004-12-31	1000	10%
中证全指复合型公用事业指数	复合公用	H30221	2004-12-31	1000	无
中证全指运输业指数	运输业	H30222	2004-12-31	1000	10%

四级行业指数名称	指数简称	指数代码	基日	基点	单个样本权重上限
中证全指证券公司指数	证券公司	399975	2007-06-30	1000	15%
中证全指贸易商指数	贸易商	H30201	2004-12-31	1000	15%
中证全指电脑与外围设备指数	电脑设备	H30207	2004-12-31	1000	15%
中证全指航运指数	航运指数	H30216	2004-12-31	1000	15%
中证全指航空运输指数	航空运输	H30223	2004-12-31	1000	无