

中证 200 指数、中证 500 指数、中证 700 指数 和中证 800 指数编制方案

中证系列规模指数分别反映沪深证券市场中不同市值规模上市公司股票的整体表现。

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

中证 200、中证 500、中证 700 和中证 800 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

中证 500、中证 800 指数的样本空间由满足以下条件的沪深 A 股构成：

(1) 上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均 A 股总市值在全部沪深 A 股中排在前 30 位；

(2) 非 ST、*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）中证 200 指数

选取沪深 300 指数样本股中剔除中证 100 指数样本股后剩余的 200 只股票构成中证 200 指数样本股。

（2）中证 500 指数

按照以下步骤进行中证 500 指数的样本股选择：

1)在样本空间中剔除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票；

2)将剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）的最近一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的股票；

3)将剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 500 名的股票组成中证 500 指数样本股。

（3）中证 700 指数

中证 500 和中证 200 指数样本股一起构成中证 700 指数样本股。

（4）中证 800 指数

中证 500 和沪深 300 指数样本股一起构成中证 800 指数样本股。

四、指数计算

中证 200、中证 500、中证 700 和中证 800 指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数})$ 。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 指数每半年调整一次样本股，样本股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%，样本调整设置缓冲区，日均成交金额排名在样本空间的剩余股票（剔除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后）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 名内的新样本优先进入，排名在 600 名之前的老样本优先保留。定期调整时，根据样本空间内股票的综合得分设置备选名单，备选名单中股票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 指数样本进行临时调整。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股票替代被剔除的股票。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当沪深 300、中证 100、中证 500 指数调整样本股时，中证 200、中证 700 和中证 800 指数随之进行相应的调整。