

中证 800 行业指数系列编制方案

为反映中证 800 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 800 指数样本按中证行业分类分为 11 个一级行业与 35 个二级行业,再以进入各一、二级行业的全部证券作为样本编制指数,形成中证 800 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

中证 800 指数样本

2、选样方法

将样本空间证券按中证行业分类方法分类,进入各一级、二级行业的全部证券形成相应中证 800 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 800 指数调整样本时，中证 800 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 800 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 800 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
中证能源指数	800 能源	000928/399928	2004-12-31	1000	15%
中证原材料指数	800 材料	000929/399929	2004-12-31	1000	无
中证工业指数	800 工业	000930/399930	2004-12-31	1000	无
中证可选消费指数	800 可选	000931/399931	2004-12-31	1000	10%
中证主要消费指数	800 消费	000932/399932	2004-12-31	1000	10%
中证医药卫生指数	800 医卫	000933/399933	2004-12-31	1000	10%
中证 800 金融指数	800 金融	H30086/000974	2004-12-31	1000	15%
中证 800 地产指数	800 地产	399965	2004-12-31	1000	15%
中证信息技术指数	800 信息	000935/399935	2004-12-31	1000	无
中证通信业务指数	800 通信	000936/399936	2004-12-31	1000	15%
中证公用事业指数	800 公用	000937/399937	2004-12-31	1000	15%

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 800 商业服务与用品指数	800 商业	H30013	2004-12-31	1000	无
中证 800 运输指数	800 运输	H30014	2004-12-31	1000	15%
中证 800 耐用消费品指数	800 耐用	H30016	2004-12-31	1000	15%
中证 800 消费者服务指数	800 服务	H30017	2004-12-31	1000	无
中证 800 传媒指数	800 传媒	H30018	2004-12-31	1000	15%
中证 800 零售业指数	800 零售	H30019	2004-12-31	1000	无
中证 800 食品饮料指数	800 食品	H30020	2004-12-31	1000	15%
中证 800 银行指数	800 银行	H30022	2004-12-31	1000	15%
中证 800 资本市场指数	800 资本	H30023	2004-12-31	1000	15%
中证 800 保险指数	800 保险	H30024	2007-12-31	1000	无
中证 800 有色金属指数	800 有色	H30031	2004-12-31	1000	15%
中证 800 制药与生物科技指数	800 医药	000841	2004-12-31	1000	15%