中证 1000 指数编制方案

中证 1000 指数选取中证 800 指数样本以外的规模偏小且流动性好的 1000 只证券作为指数样本，与沪深 300 和中证 500 等指数形成互补。

一、指数名称和代码

指数名称：中证 1000 指数

指数简称：中证 1000

英文名称：CSI 1000 Index

英文简称：CSI 1000

指数代码：000852/399852

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

同中证全指指数的样本空间

2、选样方法

（1）剔除样本空间内中证 800 指数样本及过去一年日均总市值排名前 300 名的证券；

（2）将样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的证券；

（3）将样本空间内剩余证券按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名在 1000 名之前的证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

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

其中，调整市值＝ ∑(证券价格×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

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 800 名之前的新样本优先进入，排名在 1200 名之前的老样本优先保留。

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。