

中证消费龙头指数编制方案

中证消费龙头指数从可选消费与主要消费等行业中选取规模大、经营质量好的 50 只上市公司证券作为指数样本，以反映消费龙头上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证消费龙头指数

指数简称：消费龙头

英文名称：CSI Consumer Top Index

英文简称：CSI Consumer Top

指数代码：931068

二、指数基日和基点

该指数以 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

同中证全指指数的样本空间

2、选样方法

(1) 将样本空间中属于可选消费与主要消费等行业的证券作为待选样本；

(2) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值、营业收入 (TTM)、ROE (TTM) 与毛利率 (TTM) 四个指标分别由高到低排名，将四项排名的算术平均由低到高排名作为综合排名；

(3) 将上述待选样本划分至纺织服装、休闲服务、食品等细分行业，根据各细分行业内剩余样本数量占比，分配各行业的最终入选样本数量。在每个细分行业内，选取综合排名高的证券作为指数样本，确保指数样本数量为 50 只。

四、指数计算

指数的计算公式为：

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

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。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 15%，前五大样本权重合计不超过 60%。

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

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。