

中证 A50 指数编制方案

中证 A50 指数从各行业龙头上市公司证券中，选取市值最大的 50 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性的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 A50 指数

指数简称：中证 A50

英文名称：CSI A50 Index

英文简称：CSI A50

指数代码：930050

二、指数基日和基点

该指数以 2014 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、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，剔除中证 ESG 评价结果在 C 及以下的上市公司证券；

(2) 选取同时满足以下条件的证券作为待选样本：

- 所属中证三级行业内过去一年日均自由流通市值排名第一；
- 样本空间内过去一年日均总市值排名前 300；
- 属于沪股通或深股通证券范围。

(3) 在待选样本中，选取过去一年日均自由流通市值最大的 50 只证券作为指数样本，同时满足各中证二级行业入选数量不少于 1 只。

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 = Σ (证券价格 × 调整股本数 × 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 10%，前五大样本权重合计不超过 40%。

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。定期调整设置缓冲区，在选择方法第（2）步，对中证三级行业内排名第二的原样本，若其自由流通市值不低于相应行业内排名第一证券的 80%，且符合其他条件，则仍然选取为相应行业的待选样本。定期调整的样本比例一般不超过 10%，除非因未成为待选样本而被剔除的原样本数量超过 10%。

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。当沪股通或深股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时,指数将相应调整。