

中证全指汽车指数编制方案

中证全指汽车指数从中证全指指数中选取与汽车主题相对应的上市公司证券作为指数样本，以反映该主题上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证全指汽车指数

指数简称：汽车指数

英文名称：CSI All Share Automobiles Index

英文简称：All Share Automobiles

指数代码：931008

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、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，选取主营业务涉及整

车制造、零部件制造和其他与汽车主题相关的上市公司证券作为待选样本；

(2) 在上述待选样本中，优先按照过去一年日均总市值从高到低纳入整车制造企业；若样本不足 50 只，再按照过去一年日均总市值由高到低纳入汽车零部件企业，直到补齐 50 只样本。

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。权重因子介于 0 和 1 之间，以使整车制造企业的样本权重不低于 90%，同时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。