

中证 REITs 全收益指数编制方案

中证 REITs 全收益指数选取沪深市场中满足一定流动性条件和上市时间要求的公开募集基础设施证券投资基金（REITs）作为指数样本，并将样本分红计入指数收益，以反映沪深市场上市 REITs 在计入分红收益后的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证 REITs 全收益指数
指数简称：中证 REITs 全收益
英文名称：CSI REITs Total Return Index
英文简称：CSI REITs TR
指数代码：932047

二、指数基日和基点

该指数以 2021 年 9 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

指数样本空间由沪深交易所上市时间超过三个月的 REITs 组成。

2、可投资性筛选

(1) 剔除样本空间中过去一年日均成交金额不足 500 万元的 REITs；

(2) 当沪深市场上市 REITs 数量达 50 只后，对样本空间内的 REITs 按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名位于后 10% 的 REITs。

3、选样方法

选取样本空间内符合可投资性筛选条件的 REITs 作为指数样本。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整份额数} \times \text{权重因子})$ ，除数在样本除息时予以修正。调整份额数的计算方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使当样本数量介于 10 只与 29 只时，单个样本权重不超过 15%；当样本数量达到 30 只及以上时，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

指数样本每季度调整一次，样本调整实施时间分别为每年 3 月、6 月、9 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。当样本停牌或发生其他情形时，参照计算与维护细则处理。