

## 国证 1000 行业指数系列编制方案

为反映中国 A 股市场不同行业公司股票的整体表现，编制 11 条国证 1000 行业指数，包括纯价格指数和全收益指数。其中，1000 电信指数通过国证指数网发布收盘行情数据，其余指数的纯价格指数通过深交所行情系统发布实时行情数据，全收益指数通过国证指数网发布收盘行情数据。

### 一、 代码与名称

指数代码	指数简称	指数中文名称	指数英文名称
399381	1000 能源	国证 1000 能源行业指数	CNI 1000 Energy Sector Index
399382	1000 材料	国证 1000 原材料行业指数	CNI 1000 Materials Sector Index
399383	1000 工业	国证 1000 工业行业指数	CNI 1000 Industrials Sector Index
399384	1000 可选	国证 1000 可选消费行业指数	CNI 1000 Consumer Discretionary Sector Index
399385	1000 消费	国证 1000 主要消费行业指数	CNI 1000 Consumer Staples Sector Index
399386	1000 医药	国证 1000 医药卫生行业指数	CNI 1000 Health Care Sector Index
399387	1000 金融	国证 1000 金融行业指数	CNI 1000 Financials Sector Index
399388	1000 信息	国证 1000 信息技术行业指数	CNI 1000 Information Technology Sector Index
CN5110	1000 电信	国证 1000 电信业务行业指数	CNI 1000 Telecommunication services Sector Index

399390	1000 公用	国证 1000 公用事业行业指数	CNI 1000 Utilities Sector Index
399367	1000 地产	国证 1000 房地产行业指数	CNI 1000 Real Estate Sector Index

## 二、 基日与基点

指数基日为 2002 年 12 月 31 日，指数基点为 1000。

## 三、 选样空间

国证 1000 行业指数系列以国证 1000 指数样本股为样本空间。将上市公司分为 11 个一级行业，各一级行业与二级行业（三级行业）对应关系如下表所示。

一级行业	二级行业（三级行业）
能源	能源(能源设备与服务；石油天然气；煤炭；可替代能源)
原材料	基础化工(化学原料；化学制品；农用化工；合成纤维；)； 基础材料(建筑材料；容器与包装；黑色金属；有色金属； 非金属材料与制品；纸类与林业产品)
工业	工业品(航空航天；建筑产品；电气部件与设备；工业集团企业；专用设备)；工业服务；运输
可选消费	汽车与汽车零部件；耐用消费品与服装；纺织服务与奢侈品；消费者服务；传媒；零售业
主要消费	食品与主要用品零售；农牧渔产品；家庭与个人用品
医药卫生	医疗保健设备与服务；制药；生物科技
金融	银行；资本市场服务；综合金融
信息技术	软件与服务；技术硬件与设备；半导体
电信业务	电信服务；通信设备及技术服务
公用事业	公用事业(电力公用事业；燃气公用事业；复合型公用事业；水公用事业)

房地产	房地产服务；房地产开发和管理
-----	----------------

#### 四、 选样方法

将样本空间股票按行业分类标准进行分类，进入各自行业的全部股票形成相应行业指数的初始样本股。

#### 五、 指数计算

国证 1000 行业指数系列采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

**样本股：**指纳入指数计算范围的股票。

**样本股权数：**为样本股的自由流通量，子项和母项的权数相同。

**权重调整因子：**见“八、样本股权重调整”。

**分子与分母：**分子项中的乘积为样本股经过权重调整后的实时自由流通市值，分母项中的乘积为样本股经过权重调整后的上一交易日收市自由流通市值。

**$\Sigma$ ：**是指对纳入指数计算的样本股经过权重调整后的自由流通市值进行汇总。

**自由流通量：**是上市公司实际可供交易的流通股数量，它是无限售条件股份剔除“持股比例超过 5% 的下列三类股东及其一致行动人所持有的无限售条件股份”后的流通股数量：①国有（法人）股东；②战略投资者；③公司创建者、家族或公司高管人员。

**自由流通市值：**股票价格乘以自由流通量。

**股票价格选取：**每个交易日集合竞价开市后用样本股的开市价计算开市指数，其后在交易时间内用样本股的实时成交价计算实时指数，收市后用样本股的收市价计算收市指数。样本股当日无成交的，取上一交易日收市价。样本股暂停交易的，取最近成交价。

## 六、 样本股定期调整

同国证 1000 指数。

## 七、 样本股临时调整

同国证 1000 指数。

## 八、 样本股权重调整

### 1. 样本股权重限制

若样本数量在 10 只以下，不设权重限制；若样本数量在 10 只（含 10 只）以上，则对单个样本设 15% 的权重上限限制。

### 2. 权重调整因子定期调整

权重调整因子每年调整 2 次，调整时间为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一个交易日，以调整实施日前倒数第 5 个交易日的收盘调整市值来计算权重调整因子。

### 3. 权重调整因子临时调整

在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本股临时调整时，新进指数的股票继承被删除股票在

调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进股票的权重调整因子。

当样本股股本结构出现显著变化或者其它原因导致其权重发生突变时，将决定是否对权重调整因子进行临时调整。

## 九、 指数的调整计算

同国证 1000 指数。

## 十、 指数的发布与管理

同国证 1000 指数。

## 十一、 免责声明

同国证 1000 指数。