

## 国证 1000 行业指数系列编制方案

为反映沪深北交易所不同行业公司证券的整体表现，编制国证 1000 行业指数。

### 一、代码与名称

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
国证 1000 能源行业指数	1000 能源	CNI 1000 Energy Sector Index	CNI 1000 Energy	399381
国证 1000 原材料行业指数	1000 材料	CNI 1000 Materials Sector Index	CNI 1000 Materials	399382
国证 1000 工业行业指数	1000 工业	CNI 1000 Industrials Sector Index	CNI 1000 Industrials	399383
国证 1000 可选消费行业指数	1000 可选	CNI 1000 Consumer Discretionary Sector Index	CNI 1000 Consumer Discretionary	399384
国证 1000 主要消费行业指数	1000 消费	CNI 1000 Consumer Staples Sector Index	CNI 1000 Consumer Staples	399385
国证 1000 医药卫生行业指数	1000 医药	CNI 1000 Health Care Sector Index	CNI 1000 Health Care	399386
国证 1000 金融行业指数	1000 金融	CNI 1000 Financials Sector Index	CNI 1000 Financials	399387
国证 1000 信息技术行业指数	1000 信息	CNI 1000 Information Technology Sector Index	CNI 1000 IT	399388
国证 1000 公用事业行业指数	1000 公用	CNI 1000 Utilities Sector Index	CNI 1000 Utilities	399390
国证 1000 地产行业指数	1000 地产	CNI 1000 Real Estate Sector Index	CNI 1000 Real Estate	399367

### 二、基日与基点

指数的基日为 2002 年 12 月 31 日，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；合成金属）
工业	工业品（航天航空；建筑产品；电气部件与设备；重型电气部件与设备；通用机械；工业集团企业；专用设备）；工业服务；运输
可选消费	汽车与汽车零配件；耐用消费品；纺织服装与奢侈品；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；食品饮料与烟草；家庭与个人用品
医药卫生	医疗设备与服务；制药；生物科技
金融	银行；综合金融；资本市场服务
信息技术	软件与互联网；技术硬件与设备；半导体
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

将样本空间证券按行业分类标准进行分类,进入各自行业的全部证券形成相应行业指数的初始样本。

## 五、 指数计算

指数采用派氏加权法,依据下列公式逐日连锁实时计算:

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中,样本权数调整方法参见指数计算与维护细则,权重调整因子见“七、样本权重调整”。

## 六、 样本调整

### 1. 样本定期调整

指数样本实施半年定期调整,于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本调整方案通常在实施前两周公布。

### 2. 样本临时调整

样本出现终止上市时,将其从指数样本中剔除,选择备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

样本公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同国证 1000 指数。

## 七、样本权重调整

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。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除样本在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进样本的权重调整因子。