

中证娱乐主题指数编制方案

中证娱乐主题指数选取涉及旅游、影视动漫、电子游戏、体育、图书、彩票等娱乐相关产业的沪深 A 股作为样本，采用自由流通股本加权，设置 10% 的权重上限。

一、指数名称和代码

指数名称：中证娱乐主题指数

指数简称：CS 娱乐 TI

英文名称：CSI Entertainment Thematic Index

英文简称：CSI Entertainment

指数代码：930790

二、指数基日和基点

该指数以 2012 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

中证全指指数样本股

2、选样方法

(1) 在中证全指样本空间内，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除流动性排名后 20% 的股票；

(2) 将涉及旅游、影视动漫、电子游戏、体育、图书、彩票等娱乐相关产业的公司归为娱乐主题。

(3) 按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 200 只股票构成

中证娱乐主题指数样本股。

四、 指数计算

中证娱乐主题指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本股的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使单个样本股权重不超过 10%。

五、 指数样本和权重调整

1、 定期调整

中证娱乐主题指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五收盘后的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。定期调整时，权重因子采用样本股定期调整生效日前第五个交易日的收盘后数据计算。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

特殊情况下将对中证娱乐主题指数样本进行临时调整。当样本股停牌时，中证指数有限公司将根据其停牌原因，决定是否将其从指数样本中剔除。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

当出现样本股临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，新进指数的股票继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的收盘权重，并据此计算新进股票的权重因子。