

中证电子商务主题指数编制方案

一、指数名称与代码

- 指数名称：中证电子商务主题指数
- 指数简称：中证电商
- 英文名称：CSI Electronic Commerce Thematic Index
- 英文简称：CSI E-Commerce
- 指数代码：930742
- 全收益代码：H20742

二、指数基期与基点

中证电子商务主题指数以 2012 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点。

三、样本选取方法

1、样本空间

以中证全指为样本空间。

2、选样方法：

首先，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；

其次，将涉及电子商务平台、交易服务以及商品销售的相关上市公司纳入电子商务主题；

最后，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取不超过 50 只股票作为样本股。

四、指数计算

中证电子商务主题指数采用派许加权方法，计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期成份股的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中：调整市值 = \sum (股价 × 调整股本数 × 权重上限因子)，调整股本数的计算方法同沪深 300 指数。中证电子商务主题指数设置权重上限因子，使每只股票权重不超过 10%。

五、指数修正

同沪深 300 指数。

六、指数样本调整

中证电子商务主题指数每年定期审核两次样本股，并根据审核结果调整指数样本股，样本股调整实施时间为 6 月和 12 月的第二个星期五收盘后的下一个交易日，当成份股公司有特殊情况发生时（如收购、合并、分拆、退市等），对指数进行临时调整。