

中证信托主题指数编制方案

一、指数名称与代码

- 指数名称：中证信托主题指数
- 指数简称：中证信托
- 英文名称：CSI Trust Thematic Index
- 英文简称：CSI Trust
- 指数代码：930744
- 全收益代码：H20744

二、指数基期与基点

中证信托主题指数以 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：

第一步，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 10% 的股票；

第二步，将信托行业股票按照过去一年日均总市值由高到低排名，依次纳入成份股，直到成份股数量达 20 只；

第三步，若第二步成份股数量不足 20 只，将参股信托公司的上市公司依据信托业务影响因子由高到低依次纳入成份股，直到成份股数量达 20 只。

信托业务影响因子计算方法如下：

若 母 公 司 ROE \geq 5%	信托业务影响因子=参股比例*参股信托公司净利润/母公司净利
-----------------------	-------------------------------

且 参股信托公司有净利润与收入数据披露	润
若母公司 ROE<5% 且 参股信托公司有净利润与收入数据披露	信托业务影响因子=参股比例*参股信托公司营业收入/母公司营业收入
若参股信托公司无净利润与收入数据披露	信托业务影响因子=投资金额/母公司净资产

四、指数计算

中证信托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 × 权重因子)，调整股本数的计算方法同沪深 300 指数。中证信托主题指数设置权重因子，使信托业权重为 60%，并使单个股票权重不超过 20%；使参股信托概念类权重为 40%，概念类内部权重依自由流通市值与影响因子分配，并使单个股票权重不超过 6%。信托业权重随信托业成份股数量增加而增加。

五、指数修正

同沪深 300 指数。

六、指数样本调整

中证信托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。