

中证消费驱动 100 指数编制方案

中证消费驱动 100 指数从沪深 A 股中选取消费行业中较具代表性的 100 只上市公司股票作为样本股，采用自由流通市值加权，以反映 A 股市场消费行业上市公司股票的整体表现。

一、指数名称及代码

指数名称：中证消费驱动 100 指数
指数简称：CS 消费
英文名称：CSI Consumer Driven 100 Index
英文简称：CSI Consumer Driven
指数代码：931354

二、指数基日与基点

该指数以 2008 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) 对样本空间内股票按照最近一年的 A 股日均成交金额由高到低进行排名，剔除排名后 20% 的股票；

(2) 在剩余样本中，选取属于主要消费、可选消费等行业上市公司的股票，同时按照过去一年日均总市值由高到低进行排序，选取排名靠前的 100 只股票作为指数样本股。

四、指数计算

中证消费驱动 100 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，使得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

中证消费驱动 100 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 月的第二个星期五的下一交易日。每次调整的样本比例一般不超过 20%。

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。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

特殊情况下将对指数进行临时调整。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。