

数据产品手册

服务资本市场 推动金融创新

数据产品手册

中证指数有限公司 (China Securities Index Co., Ltd.) 成立于 2005 年 8 月 25 日, 由上海证券交易所和深圳证券交易所共同出资设立, 专业从事证券指数及指数衍生产品开发服务。

中证指数有限公司在管理沪深 300 指数的基础上, 已陆续发布了中证规模指数、行业指数、债券指数、风格指数以及相关定制指数, 同时自 2007 年 4 月 9 日起, 正式受托管理和维护所有上海证券交易所系列指数。

为了更好地服务客户, 我们特编制了此数据产品手册, 内容简要包含我们现有数据服务。如果您有任何疑问, 请随时与我们联系。

地址: 上海市浦东新区锦康路 308 号 13 楼

邮编: 200127

电话: 86-21-50185500

传真: 86-21-50186368

邮箱: csindex@sse.com.cn

网站: <http://www.csindex.com.cn>

1. 指数静态数据服务

中证指数公司为客户提供指数静态数据服务，作为投资、交易、分析、业绩比较基准、产品开发和金融创新的工具。静态数据服务包含收费项目和附加增值项目，客户可通过中证指数公司或授权代理商获得相关服务，授权代理商名单详见指数公司网站。

1.1. 收费数据服务

1.1.1. 样本股权重

1.1.1.1. 当日收盘权重

当日收盘权重文件内容包括：交易日期、成份券代码、成份券名称、成份券当日收盘价、总股本、计算用股本、权重因子、总市值、计算用市值、成份券在指数中所占权重(%)等。

1.1.1.2. 次日开盘权重文件

次日开盘权重文件内容包括：调整后的股本生效日期、成份券代码、成份券名称、总股本、自由流通比例(归档后)、计算用股本、权重因子、成份券当日收盘价、成份券调整后次日开盘参考价、总市值、计算用市值、成份券在指数中所占权重(%)等。

1.1.2. 指数除数

指数除数文件内容包括：除数生效日期、指数代码、指数名称、原除数以及调整后除数等。

1.1.3. 公司行为

公司行为文件对公司未来一段时间内分红、送股、配股等事件进行提示，内容包括：生效日期、成份券代码、成份券名称、事件类型、送股比例、配股比例、配股价、分红额、价格调整因子、拟生效计算用股本、当前计算用股本等。



1.2. 增值服务

对于购买了收费数据服务的用户，中证指数公司另外赠送大量的增值服务，以满足用户更多的需求。

1.2.1. 中证/证监会行业分类

行业分类文件包含中证行业分类及证监会行业分类，内容包括：生效日期、证券代码、证券名称、所属市场、中证/证监会行业分类等。

1.2.2. 指数成份券列表

各指数成份券列表文件内容包括：成份券代码、成份券名称、所属市场等。

1.2.3. 指数行情数据

内容包括：交易日期、指数代码、指数名称、开盘值、最高值、最低值、收盘值、涨跌幅、涨跌幅(%)、成交量、成交金额、指数市值(百万)、成份券数量、指数市盈率1(总股本加权)、指数市盈率2(调整股本加权)、指数股息率1(总股本加权)以及指数股息率2(调整股本加权)等。有关市盈率和股息率的计算说明可通过中证指数公司官方网站查询。

1.2.4. 拟调入样本股权重

拟调入样本股权重文件是在调样期间，以新一期样本计算的权重文件，内容包括：成份券调入指数的日期、调整后的股本生效日期、成份券代码、成份券名称、总股本、自由流通比例(归档后)、自由流通股本(归档后)、权重因子、成份券当日收盘价、成份券调整后的次日开盘参考价、总市值、自由流通市值(归档后)、中证一级行业分类、中证二级行业分类、当前靠档比例(%)、样本调入标志等。

1.2.5. 指数基本信息表

指数基本信息表涵盖了中证指数公司所管理的所有指数的基本信息，内容包括：指数代码、指数全称、指数简称、币种、指数通代码、各交易所(上交所/深交所/港交所/台交所等)行情代码、ISIN码、SEDOL码、CUSIP码、路透码、彭博码、基日、基期、公告日期、发布日期、指数类型、指数归属等。

1.2.6. 中证债券指数系列数据文件

1.2.6.1. 中证债券估值及收益率曲线数据

内容包括：债券估值、曲线日期、年限、即期利率(%)、到期收益率(%)、远期利率(%)等。

1.2.6.2. 指数样本数据

内容包括：成份券代码、成份券名称、所属市场、发行市场数量、银行间代码、银行间名称、银行间上市日期、沪市代码、沪市名称、沪市上市、深市代码、深市名称、深市上市日期、信用类型、分析类别、计算价格所对应的收益率、计算价格所对

应的麦氏久期、计算价格所对应的修正久期、计算价格所对应的凸性、当日成交总量、结算金额、应计利息等。

1.2.6.3. 指数行情数据



内容包括：交易日期、指数代码、指数名称、指数值、涨跌幅度(%)、成交总量、结算总金额、修正久期、凸性、到期收益率、久期、指数样本数量、指数所有成份券的平均价格、以指数所有成份券的净价来计算的净价指数值、利息再投资指数值等。

1.2.7. 中证基金指数系列数据文件

1.2.7.1. 指数样本数据

内容包括：基金代码、申购代码、基金名称、基金类型等。

1.2.7.2. 指数行情数据

内容包括：交易日期、指数代码、指数名称、收盘值、涨跌值、涨跌幅(%)等。

2. 指数行情数据信息授权服务

中证指数公司针对境内外资讯商、行情商、数据集成商、互联网信息供应商，提供实时行情、延时行情和静态行情的授权服务，获得授权的用户可进行行情信息展示或转发。

2.1. 境内

境内用户可通过产品互换或付费的方式获得行情授权。授权内容包括：中证系列指数的行情数据、中证和上证系列指数的部分静态数据（行业分类、指数基本信息、证券代码对照表、指数成份券列表、公开收盘权重、指数历史行情、全收益行情、追溯行情等）。

2.2. 境外

境外用户可联系中证指数公司在境外的代理商，中国投资信息有限公司（CIIS，www.ciis.com.hk）获得相关授权。

3. 信息服务获取途径及费用收取

中证指数有限公司通过“中证指数数据服务平台”、“指数通”、“深证通”、公司网站 (<http://www.csindex.com.cn>) 等方式提供数据服务, 其中部分信息涉及收费。同时, 也可通过中证指数授权资讯商和代理商获取相关数据服务。欲知详情, 请与我们联系。

注: 以上服务列表和数据文件仅作为内部参考用, 且部分涉及收费, 如有疑问, 请与中证指数有限公司接洽; 中证指数有限公司保留对服务列表和数据文件的内容、格式及传输方式变更的权力。