

中证新能源产业指数编制方案

中证新能源产业指数选取新能源产业上游原材料，新能源中游生产及设备制造，新能源下游应用、存储及交互设备、新能源汽车等代表性上市公司证券作为指数样本，采用等权重加权，为投资者提供更多样化的投资标的。

一、指数名称和代码

指数名称：中证新能源产业指数

指数简称：CS 新能源

英文名称：CSI New Energy Industry Index

英文简称：CSI New Energy Industry

指数代码：930771

二、指数基日和基点

该指数以 2011 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

同中证全指指数的样本空间

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 对样本空间内剩余证券，选取新能源产业的上游原材料，新能源（核能、风能、太阳能、页岩气、生物质能、地热能和潮汐能等）中游生产，新能源

下游应用、存储及交互设备（如锂电池、铅酸电池、充电桩、超级电容等）、新能源汽车等上市公司证券作为待选样本；

（3）在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名前 80 名的证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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。权重调整因子介于 0 和 1 之间，以使所有样本权重相等。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，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。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。