

中证新能源汽车产业指数编制方案

中证新能源汽车产业指数选取 50 只业务涉及新能源整车、电机电控、锂电设备、电芯电池、电池材料等新能源汽车产业的上市公司证券作为指数样本，反映新能源汽车产业龙头上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证新能源汽车产业指数

指数简称：新能源车

英文名称：CSI New Energy Vehicles Industry Index

英文简称：New Energy Vehicles

指数代码：930997

二、指数基日和基点

该指数以2014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

中证全指指数样本空间中沪深市场证券

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取业务涉及新能源整车、电机电控、锂电设备、电芯电池、电池材料以及相关上游材料等新能源汽车产业的上市公司证券作为待选样本；

(2) 根据上市公司所在产业链环节，将待选样本进一步划分至各细分领域，包含但不限于新能源整车、电机电控、锂电设备、动力锂电池、电池正极、电池负极、电解液等；

(3) 在各细分领域按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 2 的上市公司证券作为指数样本；在剩余待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，依次选入排名靠前的证券，直至样本数量达到 50。

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。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%。

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。