

中证半导体行业精选指数编制方案

中证半导体行业精选指数从半导体行业中选取 50 只规模较大、盈利能力较好、研发投入较高且具备一定成长潜力的上市公司证券作为指数样本，反映半导体行业内兼具代表性与可投资性的上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证半导体行业精选指数

指数简称：半导体行业精选

英文名称：CSI Semiconductor Industry Custom Index

英文简称：Semiconductor Industry Custom

指数代码：932066

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

同中证全指指数的样本空间

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，选取半导体行业的上

上市公司证券作为待选样本；

(2) 在上述待选样本中，剔除中证 ESG 评价结果中公司治理维度得分排名在后 20% 的证券，若剔除后待选样本数量少于 50，则豁免剔除；

(3) 对于剩余待选样本，计算过去一年日均总市值、净资产收益率、研发投入占营业收入比例、净利润增长率等四个指标的百分比排名的算术平均值作为综合得分，按照综合得分由高到低排名，选取排名前 50 的证券作为指数样本，其中过去一年日均总市值排名前 5 或营业收入 TTM 排名前 5 的证券优先入选。

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 15%，前五大样本合计权重不超过 60%。

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。每次调整的样本数量比例一般不超过 30%。采用缓冲区规则，排名在前 40 名的候选新样本优先进入指数，排名在前 60 名的老样本优先保留。

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。