

中证新兴产业 60 指数编制方案

中证新兴产业 60 指数从内地与香港市场选取绿色能源、先进制造、生物科技、现代消费、新一代信息技术、新型装备、新经济业态等新兴产业领域的 60 家代表性上市公司证券，以反映新兴产业领域上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证新兴产业 60 指数

指数简称：新兴 60

英文名称：CSI Emerging Industries 60 Index

英文简称：Emerging 60

指数代码：932661

二、指数基日和基点

该指数以2022年12月30日为基日，以1000点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

内地市场：同中证全指指数的样本空间

香港市场：中证港股通综合指数样本

2、可投资性筛选

对于内地市场证券，过去一年日均成交金额位于样本空间前 90%；对香港市场证券，计算每月的日换手率中位数作为月换手率，剔除过去 12 个月或过去 3

个月平均月换手率不足 0.1% 的证券，除非该证券过去一年日均成交金额大于 5000 万港元。

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，选取沪股通、深股通和港股通范围内的内地上市公司证券作为待选证券；

(2) 对于上述待选证券，选取绿色能源、先进制造、生物科技、现代消费、新一代信息技术、新型装备、新经济业态等领域上市公司证券作为待选样本；

(3) 对待选样本，按过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名靠前的 60 只证券作为指数样本。若同公司的内地市场和香港市场证券同时入选，选取其内地市场证券作为指数样本。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。汇率、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，以使所有证券权重相等。

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。当沪港通、深股通和港股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时，指数将相应调整。