

中证细分产业主题指数系列编制方案

中证细分产业主题指数系列由细分能源、细分有色等 8 条指数组成，分别从沪深市场相关细分产业中选取规模较大、流动性较好的上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场相关细分产业上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
中证细分能源产业主题指数	细分能源	CSI Energy Sub-industry Index	Energy Sub-industry	000810
中证细分有色金属产业主题指数	细分有色	CSI Non-ferrous Metal Sub-industry Index	Non-ferrous Metal Sub-industry	000811
中证细分机械设备产业主题指数	细分机械	CSI Machinery Sub-industry Index	Machinery Sub-industry	000812
中证细分化工产业主题指数	细分化工	CSI Chemicals Sub-industry Index	Chemicals Sub-industry	000813
中证细分医药产业主题指数	细分医药	CSI Health Care Sub-industry Index	Health Care Sub-industry	000814
中证细分食品饮料产业主题指数	细分食品	CSI Food & Beverage Sub-industry Index	Food & Beverage Sub-industry	000815
中证细分房地产产业主题指数	细分地产	CSI Real Estate Sub-industry Index	Real Estate Sub-industry	000816
中证细分金融产业主题指数	细分金融	CSI Financials Sub-industry Index	Financials Sub-industry	000818

二、指数基日和基点

该指数系列以 2004 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) 进行主题证券筛选：能源等行业归为细分能源主题；有色金属采矿等行业归为细分有色主题；电力设备等行业归为细分机械主题；化学制品等行业归为细分化工主题；制药、生物科技与生命科学等行业归为细分医药主题；食品制造等行业归为细分食品主题；房地产等行业归为细分地产主题；银行保险等行业归为细分金融主题；

(3) 选取各主题类别中过去一年日均总市值最大的 50 只证券作为指数样本，若某主题证券数量少于 50 只，则将其全部纳入相应主题指数。

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%。

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。