

中证产业链指数系列编制方案

中证产业链指数系列由中证上游资源产业指数、中证中游制造产业指数以及中证下游消费与服务产业指数等三条指数构成，分别从中证 800 指数样本中选取规模大、具有相关产业链特征的上市公司证券作为指数样本，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	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
中证上游资源产业指数	中证上游	CSI Upstream Resources Industry Index	CSI Upstream	000961
中证中游制造产业指数	中证中游	CSI Midstream Manufacturing Industry Index	CSI Midstream	000962
中证下游消费与服务产业指数	中证下游	CSI Downstream Consumption and Services Industry Index	CSI Downstream	000963

二、指数基日和基点

该指数以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

中证 800 指数样本

2、选样方法

(1) 产业链的划分：将石油、天然气、煤炭、有色金属、非金属采矿及制品等行业的证券归为上游资源产业；将化学制品、钢铁、机械制造、通信设备等；

行业的证券归为中游制造产业；将汽车、消费者服务、耐用消费品及服装、食品饮料、医疗保健、电信服务等行业的证券归为下游消费与服务产业；

(2) 对样本空间内证券，将归属于每个产业的证券按照过去一年日均总市值由高到低排名，在上游资源产业中选取排名靠前的 50 只证券作为中证上游资源产业指数样本，在中游制造产业选取排名靠前的 250 只证券作为中证中游制造产业指数样本，在下游消费与服务产业中选取排名靠前的 200 只证券作为中证下游消费与服务产业指数样本。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数})$ 。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。

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。

2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。对于符合选样条件且发行总市值排名在沪深市场前 10 位的新发行证券，启用快速进入指数规则，即在其上市第十个交易日结束后将其纳入相应产业链指数，同时剔除原样本中过去一年日均总市值排名最末的证券。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。