

中证内地新能源主题指数编制方案

中证内地新能源主题指数从沪深市场中涉及新能源生产、新能源存储以及新能源汽车等业务的上市公司证券中选取新能源业务规模较大、盈利较好的 50 只样本作为指数样本，为市场提供多样化的投资标的。

一、指数名称和代码

指数名称：中证内地新能源主题指数

指数简称：新能源

英文名称：CSI CN Mainland New Energy Index

英文简称：CN New Energy

指数代码：000941

二、指数基日和基点

该指数以 2008 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

流动性要求：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，选取以下新能源业务占比 30% 以上的上市公司证券作为待选样本：

- 新能源生产：太阳能、风能、核能、生物质能、地热能、海洋能和氢能等；
- 新能源储存与应用：新能源储存技术与装备、新能源汽车等；

(2) 在上述待选样本中，按照营业利润（TTM）与归属于新能源业务的营业收入分别由高到低排名，将两项排名的算数平均数作为新能源业务体量得分；

(3) 在上述待选样本中，按照扣非 ROE（TTM）由高到低排名，作为盈利能力得分；

(4) 将新能源业务体量得分与盈利得分算数平均作为综合得分，在剩余证券中，按照综合得分从高到低排序，选取排名靠前的 50 只证券作为指数样本，不足 50 只时全部纳入。

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%，前五大样本权重合计不超过 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。

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。