

沪深 300 周期行业指数与沪深 300 非周期行业指数编制方案

沪深 300 周期行业指数和沪深 300 非周期行业指数从沪深 300 指数样本中分别选取周期和非周期行业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
沪深 300 周期行业指数	300 周期	CSI 300 Cyclical Industry Index	CSI 300 Cyclical	000968/399968
沪深 300 非周期行业指数	300 非周	CSI 300 non-Cyclical Industry Index	CSI 300 non-Cyclical	000969/399969

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

沪深 300 指数样本

2、选样方法

(1) 根据证监会行业分类标准，将金融保险、采掘业、交通运输仓储业、金属非金属、房地产等行业的证券归为周期性行业证券，将其余行业的证券归为非周期性行业证券；

(2) 对样本空间内证券，选取所有周期性行业证券作为沪深 300 周期行业指数样本；选取所有非周期性行业证券作为沪深 300 非周期行业指数样本。

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

当沪深 300 指数调整样本时，指数样本随之进行相应调整。若样本公司有特殊事件发生，导致其行业属性发生变化，指数进行相应的调整。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。