

中证半导体产业指数编制方案

中证半导体产业指数选取不超过 40 只业务涉及半导体材料、设备和应用等相关领域的上市公司证券作为指数样本，以反映半导体核心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：中证半导体产业指数

指数简称：中证半导

英文名称：CSI Semiconductor Industry Index

英文简称：CSI Semiconductor

指数代码：931865

二、指数基日和基点

该指数以 2016 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

同中证全指指数的样本空间

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 80%。

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，选取业务涉及半导体材料、半导体设备以及半导体应用的上市公司证券作为待选样本；

(2) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，首先从半导体材料和设备类证券中选取排名前 40 的证券作为指数样本；若不足 40 只，则从半导体应用类证券中依次补充，使得样本数量达到 40 只。

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，以使样本采用系数调整后自由流通市值加权，且单个样本权重不超过 15%，半导体材料和设备类样本合计权重不低于 75%。系数调整后自由流通市值计算方法如下：

根据过去一年日均总市值、营业收入 TTM 同比增长率、过去三年毛利率均值和研发支出占比四项指标的综合排名分为三档，依次设置 1、0.5、0.25 的调整系数，将调整系数与自由流通市值相乘即得到系数调整后自由流通市值。

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。