

中证芯片产业指数编制方案

中证芯片产业指数从沪深 A 股中选取业务涉及芯片设计、制造、封装与测试等领域，以及为芯片提供半导体材料、晶圆生产设备、封装测试设备等物料或设备的上市公司股票作为样本股，以反映芯片产业上市公司股票的整体表现。

一、 指数名称及代码

指数名称：中证芯片产业指数

指数简称：芯片产业

英文名称：CSI Chip Industry Index

英文简称：Chip Industry

指数代码：H30007

二、 指数基日与基点

该指数以 2015 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

中证全指指数样本股

2、选样方法

(1) 对样本空间内的股票按照最近一年的 A 股日均成交金额由高到低进行排名，剔除排名后 20% 的股票；

(2) 在剩余样本中，选取业务涉及芯片设计、制造、封装与测试等领域，

以及为芯片提供半导体材料、晶圆生产设备、封装测试设备等物料或设备的上市公司股票作为待选样本；

(3) 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，选取排名前 50 名的股票构成指数样本股，不足 50 只时全部纳入。

四、 指数计算

中证芯片产业指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本股的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ ，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，以使芯片相关业务占比较低的单个样本股权重不超过 5%，其它单个样本股权重不超过 10%。

五、 指数样本和权重调整

1、定期调整

中证芯片产业指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整，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。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。