目录

[一、数据需求汇总 2](#_Toc102937377)

[计算用数据： 2](#_Toc102937378)

[二、指数样本股确定方式汇总 4](#_Toc102937379)

[沪深300 4](#_Toc102937380)

[中证500 5](#_Toc102937381)

[上证180 6](#_Toc102937382)

[上证50 7](#_Toc102937383)

[结构调整 7](#_Toc102937384)

[证券公司（中证全指行业指数） 8](#_Toc102937385)

[中证银行（中证全指细分行业指数） 9](#_Toc102937386)

[中证全指半导体（中证全指细分行业指数） 10](#_Toc102937387)

[中证白酒 10](#_Toc102937388)

[中证酒 11](#_Toc102937389)

[光伏产业 11](#_Toc102937390)

[5G通信 12](#_Toc102937391)

[CS新能车 13](#_Toc102937392)

[新能源车 13](#_Toc102937393)

[基建工程 14](#_Toc102937394)

[中证医疗 15](#_Toc102937395)

[中证军工 15](#_Toc102937396)

[中华半导体芯片（中华交易服务委托中证指数） 16](#_Toc102937397)

[科创50 17](#_Toc102937398)

[科创创业50 18](#_Toc102937399)

[创业板指（国证指数） 18](#_Toc102937400)

[创业板50（国证指数） 19](#_Toc102937401)

[国证芯片（国证指数） 20](#_Toc102937402)

[生物医药（国证指数） 21](#_Toc102937403)

[MSCI中国A50互联互通 22](#_Toc102937404)

[红利指数（年度更新，本次不更新） 23](#_Toc102937405)

# 一、数据需求汇总

## 计算用数据：

（简单说明：1的数据主要用于校对；2-7是大多数指数用到的数据；8、9、10是“结构调整”这一指数可能会用到的数据；11涉及一些模糊筛选条件，或者可能可以通过中证行业分类信息直接获取，或者通过个股主营业务介绍字段判断，或者需要其他信息判断）

1. 各指数成分股数据**（似乎叫ashareindexmember，用于校对）**
2. A股ST信息表格（包含ST、\*ST、暂停上市股票信息）。**最新全表**
3. A股基本信息表格（包含上市日信息、所属板块信息）。**最新全表**
4. 中证行业分类信息、GICS行业板块分类。**最新全表（包含这两种分类）**
5. 个股自由流通股股本数据。**全部历史数据（需要包含自由流通股股本字段）**
6. 成交金额数据**（ashareeodprices，从2021-01-01至今，需要包含收盘价和成交金额字段）**
7. 总市值数据**（从2021-01-01至今，包含总市值数据即可）**
8. 利润表数据**（ashareincome，2022-01-01至今）**
9. 资产负债表**（asharebalancesheet，2022-01-01至今）**
10. 分红数据表格**（asharedividend，ex\_dt字段2022-01-01至今，或者直接整张表）**
11. 一些模糊的选样条件，涉及的数据和信息尚未判定（不确定能否通过中证行业分类信息选样），包括

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 指数 | 名称 | 选样方法节选（模糊部分） |
| 399997.SZ | 中证白酒 | 对样本空间的剩余股票，选取**涉及白酒生产业务的上市公司股票**纳入白酒主题； |
| 399987.SZ | 中证酒 | 对样本空间内剩余证券，选取**涉及白酒、啤酒、葡萄酒酿造等业务的上市公司证券**作为待选样本； |
| 931151.CSI | 光伏产业 | 对样本空间的剩余股票，将**主营业务涉及光伏产业链上、中、下游的上市公司股票**作为样本股，业务范围包括但不限于硅片、多晶硅、电池片、电缆、光伏玻璃、电池组件、逆变器、光伏支架和光伏电站等 |
| 931079.CSI | 5G通信 | 对样本空间内的剩余股票，选取**产品和业务与5G通信技术相关的上市公司股票**作为样本股，相关领域包括但不限于电信服务、通信设备、计算机及电子设备和计算机运用等细分行业。 |
| 399976.SZ | CS新能车 | 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券 ，选取**涉及锂电池、充电桩、新能源整车等业务的上市公司证券**作为待选样本作为待选样本； |
| 930997.CSI | 新能源车 | 在剩余样本中，选取**业务涉及新能源汽车产业的股票**作为样本股，具体包括新能源整车、充电桩、锂电设备、电机电控、电池材料、电芯电池组、配套设备以及相关上游材料等。 |
| 399989.SZ | 中证医疗 | 对样本空间内剩余证券，选取**业务涉及医疗器械、医疗服务、医疗信息化等医疗主题的上市公司证券**作为待选样本； |
| 399967.SZ | 中证军工 | 对样本空间的剩余股票，将由**十大军工集团控股且主营业务与军工行业相关的上市公司**，业务范围涵盖航空、航天、船舶、兵器、军事电子和卫星等军工领域的其他军工类上市公司作为待选样本； |
| 990001.CSI | 中华半导体芯片 | 半导体芯片行业甄选：样本股的**主营业务收入须来自半导体芯片材料、设备、设计、制造、封装或测试**； |
| 931643.CSI | 科创创业50 | 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取**新一代信息技术产业、高端装备制造产业、新材料产业、生物产业、新能源汽车产业、新能源产业、节能环保产业、数字创意产业等新兴产业上市公司证券**作为待选样本； |
| 980017.CNI | 国证芯片 | **公司业务范畴属于芯片产业中材料、设备、设计、制造、封装和测试等**。 |
| 399441.SZ | 生物医药 | 公司业务领域属于**生物医药产业** |
| 746059.MI | MSCI中国A50互联互通 | 首先选择中国A股证券，然后剔除**无法通过“互联互通”机制投资的中国A股证券**。 |
| 000860.CSI | 结构调整 | （1）对样本空间内股票按照过去一年的A股日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票； （2）从样本空间剩余样本的**国务院国资委及其管理央企集团实际控制或能施加重大影响的上市公司**中，分别将**属于国民经济重要领域、战略新兴产业、科技创新行业，符合央企兼并重组方向，以及归属于央企改革试点集团的上市公司股票**作为待选样本； （3）在上述待选样本中，剔除过去两年扣非净利润均为负的上市公司股票； （4）对剩余待选样本的**市值规模、股东权益回报、红利支付水平、科技创新投入、国际业务发展情况进行评估打分**，并对这五个方面得分分别进行标准化处理，最后将五个标准化值以30%、10%、20%、30%、10%的权重求和得到个股综合得分； （5）在剩余待选样本中，基于营业收入与营业利润，选取各行业龙头企业股票优先作为指数样本股；再从剩余待选样本中，依次选取综合得分最高的股票作为指数样本股，直至样本股总数达100只，且单一行业样本数量不超过10只。 |

# 二、指数样本股确定方式汇总word版

下文是从编制规则pdf文件中摘取的工作涉及的关键内容，更直观的精炼版见excel文件“指数样本股确定方式汇总.xlsx”。

## 沪深300

1、样本空间

指数样本空间由同时满足以下条件的非ST、\*ST 沪深A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：

（1）科创板证券、创业板证券：上市时间超过一年。

（2）其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前30位。

2、选样方法

沪深300指数样本是按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、证券价格无明显异常波动或市场操纵的公司：

（1）对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后50%的证券；

（2）对样本空间内剩余证券，按照过去一年的日均总市值由高到低排名，选取前300名的证券作为指数样本。

3、样本调整

依据样本稳定性和动态跟踪相结合的原则，每半年审核一次沪深300指数样本股，并根据审核结果调整指数样本股。

（1）审核时间

一般在每年5 月和11 月的下旬审核沪深300 指数样本股，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。

（2）审核参考依据

每年5 月份审核样本股时，参考依据主要是上一年度5月1日至审核年度4月30日（期间新上市股票为上市第四个交易日以来）的交易数据及财务数据；每年11 月份审核样本股时，参考依据主要是上一年度11月1日至审核年度10月31日（期间新上市股票为上市第四个交易日以来）的交易数据及财务数据。

（3）样本股调整数量

定期调整指数样本时，每次调整数量比例一般不超过10%。

（4）老样本成交金额缓冲区规则

如果沪深300指数老样本日均成交金额在样本空间中排名前60%，则参与下一步日均总市值的排名。

（5）缓冲区规则

为有效降低指数样本股周转率，沪深300指数样本股定期调整时采用缓冲区规则，排名在前240名的候选新样本优先进入指数，排名在前360名的老样本优先保留。

（6）备选名单

对沪深300指数进行定期审核时，设置备选名单用以定期调整之间的临时调整。详细内容见第8节“指数备选名单”。

（7）长期停牌股票的处理

①对于沪深300 指数的样本股，在定期审核样本资格时：

至数据考察截止日已连续停止交易超过25个交易日且仍未恢复交易的样本股，如果落入候选剔除名单，则原则上列为优先剔除股票。

至数据考察截止日连续停止交易接近25个交易日，且仍未恢复交易的样本股，由专家委员会讨论决定是否列为候选剔除股票。

若剔除股票处于停牌状态且停牌原因为重大负面事件，则以0.00001 元价格剔除，若其在距生效日至少一个交易日前复牌，则变更为最新收盘价并公告。其他情况则以停牌前收盘价剔除。

②对于尚未进入指数的股票，在定期审核样本资格时：

至指数专家委员会召开日处于停牌状态且无明确复牌预期的股票原则上不能成为候选新进股票样本。

在数据考察时段内连续停止交易超过25个交易日的股票，恢复交易3个月后才可以进入指数，专家委员会允许的特殊情形除外。

对定期调整公告日和生效日之间停牌的新进股票样本，中证指数有限公司将决定是否对其进行调整。

（8）财务亏损股票的处理

定期审核样本股时，财务亏损的股票原则上不列为候选新样本，除非该股票影响指数的代表性。

## 中证500

1、样本空间（同沪深300）

沪深300 指数样本空间由同时满足以下条件的沪深A 股组成：

（1）非创业板股票：上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来日均A 股总市值在全部沪深A 股（非创业板股票）中排在前30 位；创业板股票：上市时间超过三年

（2）非ST、\*ST 股票，非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）在样本空间中剔除沪深300指数样本股及最近一年日均总市值排名前300名的股票；

（2）将剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票；

（3）将剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前500 名的股票组成中证500指数样本股。

3、样本调整

（1）定期调整

中证500指数每半年调整一次样本股，样本股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。每次调整的样本比例一般不超过10%，样本调整设置缓冲区，日均成交金额排名在样本空间的剩余股票（剔除沪深300指数样本股及最近一年日均总市值排名前300名的股票后）前90%的老样本可参与下一步日均总市值排名；日均总市值排名在400名内的新样本优先进入，排名在600名之前的老样本优先保留。定期调整时，根据样本空间内股票的综合得分设置备选名单，备选名单中股票数量一般为指数样本数量的5%。

（2）临时调整

特殊情况下将对中证500指数样本进行临时调整。发生临时调整时，由最近一次指数定期调整时备选名单中排名最高的股票替代被剔除的股票。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当沪深300、中证100、中证500指数调整样本股时，中证200、中证700和中证800指数随之进行相应的调整。

## 上证180

1、样本空间

上证180指数的样本空间由剔除下列股票后的所有沪市A股组成：

（1）上市时间不足一个季度的股票，除非该股票的日均总市值排在沪市的前18位；

（2）暂停上市股票。

2、选样方法

上证180指数样本按照以下四个步骤选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、股票价格无明显异常波动或市场操纵的公司：

（1）根据总市值和成交金额对股票进行综合排名。具体方法是：根据过去一年的日均数据，对各指标分别排名，然后将各指标的排名结果相加，所得和的排名作为股票的综合排名；

（2）按照行业的自由流通调整市值比例分配样本只数。具体计算方法如下：

第i行业样本配额=第i 行业所有候选股票自由流通调整市值之和/样本空间所有候选股票自由流通调整市值之和×180；

（3）按照行业的样本分配只数，在行业内选取综合排名最靠前的股票；

（4）对各行业选取的样本作进一步调整，使成份股总数为180 只。

3、样本调整

（1）定期调整

上证180指数每半年调整一次样本股，样本股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。每次调整的样本比例一般不超过10%。

（2）临时调整

特殊情况下将对上证180指数样本进行临时调整。对新发行股票的A股发行总市值（总市值=发行价×A股总股本）和沪市A股自该新发行股票上市公告日起过去一年的日均A股总市值进行比较，对于符合样本空间条件、且A股发行总市值排名在沪市A股市场前10位的新发行A股股票，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上证180指数，同时剔除上证180指数原样本所属行业中最近一年日均总市值、成交金额综合排名最末的股票。

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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

## 上证50

1、样本空间

上证180指数样本股。

2、选样方法

对样本空间内的股票按照最近一年总市值、成交金额进行综合排名，选取排名前50位的股票组成样本，但市场表现异常并经专家委员会认定不宜作为样本的股票除外。

3、样本股调整

（1）定期调整

上证50指数每半年调整一次样本股，样本股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。每次调整数量一般不超过10%，样本调整设置缓冲区，排名在前40名的候选新样本优先进入，排名在前60名的老样本优先保留。

（2）临时调整

特殊情况下将对上证50指数样本进行临时调整。对新发行股票的A股发行总市值（总市值=发行价×A股总股本）和沪市A 股自该新发行股票上市公告日起过去一年的日均A股总市值进行比较，对于符合样本空间条件、且A股发行总市值排名在沪市A股市场前10位的新发行A股股票，启用快速进入指数的规则，即在其上市第十个交易日结束后将其纳入上证50指数，同时剔除上证50指数原样本中最近一年日均总市值、成交金额综合排名最末的股票。

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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

## 结构调整

1、样本空间（中证全指指数样本股）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）对样本空间内股票按照过去一年的A股日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票；

（2）从样本空间剩余样本的国务院国资委及其管理央企集团实际控制或能施加重大影响的上市公司中，分别将属于国民经济重要领域、战略新兴产业、科技创新行业，符合央企兼并重组方向，以及归属于央企改革试点集团的上市公司股票作为待选样本；

（3）在上述待选样本中，剔除过去两年扣非净利润均为负的上市公司股票；

（4）对剩余待选样本的市值规模、股东权益回报、红利支付水平、科技创新投入、国际业务发展情况进行评估打分，并对这五个方面得分分别进行标准化处理，最后将五个标准化值以30%、10%、20%、30%、10%的权重求和得到个股综合得分；

（5）在剩余待选样本中，基于营业收入与营业利润，选取各行业龙头企业股票优先作为指数样本股；再从剩余待选样本中，依次选取综合得分最高的股票作为指数样本股，直至样本股总数达100只，且单一行业样本数量不超过10只。

3、样本股调整

（1）定期调整

中证央企结构调整指数的样本股每半年调整一次，样本股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。每次调整的样本比例一般不超过20%。样本调整设置缓冲区，排名在80名内的新样本优先进入，排名在120名之前的老样本优先保留。

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。

## 证券公司（中证全指行业指数）

1、样本空间（中证全指指数）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A 股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）将样本空间证券按中证行业分类方法分类；

（2）如果行业内证券数量少于或等于50只，则全部证券作为相应全指行业指数的样本；

（3）如果行业内证券数量多于50只，则依次剔除行业内全部证券成交金额排名后10%的证券以及累积总市值占比达行业内全部证券98%以后的证券，剔除过程中优先确保剩余证券数量不少于50只，将剩余证券作为相应行业指数的样本。

3、样本调整

（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

当中证全指指数调整样本时，中证全指行业指数样本随之进行相应调整。在样本公司有特殊事件发生，导致其行业归属发生变更时，将对中证全指行业指数样本进行相应调整。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。

## 中证银行（中证全指细分行业指数）

1、样本空间（中证全指指数样本股）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）将样本空间股票按中证行业分类方法分类；

（2）如果行业内股票数量少于或等于50只，则全部股票构成相应全指行业指数的样本股；

（3）如果行业内股票数量多于50只，则分别按照股票的日均成交金额、日均总市值由高到低排名，剔除成交金额排名后10%、以及累积总市值占比达到98%以后的股票，并且保持剔除后股票数量不少于50只；行业内剩余股票构成相应行业指数的样本股。

3、样本调整

（1）定期调整

中证全指细分行业指数的样本股每半年调整一次，样本调整实施时间为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。当中证全指指数调整成份股时，中证全指细分行业指数成份股随之进行相应调整

（2）临时调整

特殊情况下将对中证全指细分行业指数样本进行临时调整。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

## 中证全指半导体（中证全指细分行业指数）

1、样本空间（中证全指指数样本股）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）将样本空间股票按中证行业分类方法分类；

（2）如果行业内股票数量少于或等于50只，则全部股票构成相应全指行业指数的样本股；

（3）如果行业内股票数量多于50只，则分别按照股票的日均成交金额、日均总市值由高到低排名，剔除成交金额排名后10%、以及累积总市值占比达到98%以后的股票，并且保持剔除后股票数量不少于50只；行业内剩余股票构成相应行业指数的样本股。

3、指数样本调整

（1）定期调整

中证全指细分行业指数的样本股每半年调整一次，样本调整实施时间为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。当中证全指指数调整成份股时，中证全指细分行业指数成份股随之进行相应调整。

（2）临时调整

特殊情况下将对中证全指细分行业指数样本进行临时调整。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

## 中证白酒

1、样本空间（中证全指指数样本股）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）对样本空间内的股票按照最近一年（新股上市以来）的A股日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票；

（2）对样本空间的剩余股票，选取涉及白酒生产业务的上市公司股票纳入白酒主题；

（3）将（2）中剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名选取排名前50的股票作为指数样本股。

3、样本调整

（1）定期调整

中证白酒指数每半年调整一次，样本股调整实施时间为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。

（2）临时调整

特殊情况下将对中证白酒指数样本进行临时调整。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、停牌等情形参照计算与维护细则处理。

当出现样本股临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，新进指数的股票一般情况下将继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的收盘权重，并据此计算新进股票的权重因子。

## 中证酒

1、样本空间（同中证全指指数的样本空间）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的证券；

（2）对样本空间内剩余证券，选取涉及白酒、啤酒、葡萄酒酿造等业务的上市公司证券作为待选样本；

（3）将待选样本按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前50名的证券作为指数样本。

3、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。

## 光伏产业

1、样本空间（中证全指指数样本股）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）对样本空间内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）对样本空间的剩余股票，将主营业务涉及光伏产业链上、中、下游的上市公司股票作为样本股，业务范围包括但不限于硅片、多晶硅、电池片、电缆、光伏玻璃、电池组件、逆变器、光伏支架和光伏电站等

（3）在上述待选样本中，按照最近一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名前50的股票作为指数样本股，不足50只时全部纳入。

3、样本调整

（1）定期调整

中证光伏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月的第二个星期五收盘后的下一交易日。

（2）临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。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。

## 5G通信

1、样本空间（中证全指指数样本股）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）对样本空间内股票分别按照最近一年（新股为上市以来）的A股日均总市值和日均成交金额由高到低进行排名，并分别剔除排名后 20%的股票；

（2）对样本空间内的剩余股票，选取产品和业务与5G通信技术相关的上市公司股票作为样本股，相关领域包括但不限于电信服务、通信设备、计算机及电子设备和计算机运用等细分行业。

3、样本调整

（1）定期调整

中证5G通信主题指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施日为每年6月和12月的第二个星期五收盘后的下一交易日。

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

特殊情况下将对中证5G 通信主题指数样本进行临时调整。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除；当样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形时，参照计算与维护细则处理。

## CS新能车

1、样本空间（同中证全指指数的样本空间）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

流动性要求：过去一年日均成交金额排名位于样本空间前80%。

（1）对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券 ，选取涉及锂电池、充电桩、新能源整车等业务的上市公司证券作为待选样本；

（2）将待选样本将待选样本按照按照过去过去一年日均总市值由高到低排名，一年日均总市值由高到低排名，选取排名前选取排名前50的的证券作为指数样本证券作为指数样本。

3、样本调整

（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。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。

## 新能源车

1、样本空间（中证新能源汽车产业指数以中证全指为样本空间）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）剔除样本空间内过去一年日均成交金额排名在后10%的股票。

（2）在剩余样本中，选取业务涉及新能源汽车产业的股票作为样本股，具体包括新能源整车、充电桩、锂电设备、电机电控、电池材料、电芯电池组、配套设备以及相关上游材料等。

3、样本调整

（1）定期调整

中证新能源汽车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。

（2）临时调整

特殊情况下将对指数样本进行临时调整。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

## 基建工程

1、样本空间（中证全指指数样本股）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）对样本空间内的股票按照最近一年（新股上市以来）的A股日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票；

（2）对样本空间的剩余股票，按照中证行业分类，选取归属于建筑与工程行业的上市公司股票纳入基建工程主题；

（3）将（2）中剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名前50的股票作为指数样本股。

3、指数样本和权重调整

（1）定期调整

中证基建工程指数每半年调整一次，样本股调整实施时间为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。

（2）临时调整

特殊情况下将对中证基建工程指数样本进行临时调整。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

## 中证医疗

1、样本空间（同中证全指指数的样本空间）

中证全指指数的样本股由满足以下条件的沪深A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）非ST、\*ST 股票、非暂停上市股票。

2、选样方法

（1）对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的证券；

（2）对样本空间内剩余证券，选取业务涉及医疗器械、医疗服务、医疗信息化等医疗主题的上市公司证券作为待选样本；

（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的证券作为指数样本，不足50只时全部纳入。

3、样本调整

（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。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。

## 中证军工

1、样本空间

中证军工指数的样本 空间由满足以下条件的沪深 A 股构成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均A股总市值在全部沪深A股中排在前30位；

（2）不含ST股票、\*ST 股票、暂停上市股票。

2、选样方法

（1）对样本空间内股票按照最近一年（新股为上市以来）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）对样本空间的剩余股票，将由十大军工集团控股且主营业务与军工行业相关的上市公司，业务范围涵盖航空、航天、船舶、兵器、军事电子和卫星等军工领域的其他军工类上市公司作为待选样本；

（3）在待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取不超过80只股票构成指数样本股。

3、样本调整

（1）定期调整

中证军工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，每次调整的样本周转率不超过10%。

（2）临时调整

特殊情况下将对指数样本进行临时调整。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当出现样本股临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，新进指数的股票一般情况下将继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的收盘权重，并据此计算新进股票的权重因子。

## 中华半导体芯片（中华交易服务委托中证指数）

1、样本空间

中华半导体芯片样本空间的样本空间由同时满足以下条件的沪深A股组成：

（1）在审核截止日股票必须上市超过三个月；

（2）非ST、\*ST股票，非暂停上市股票；

（3）最近一年无重大违法违规事件、财务报告无重大问题。

2、选样方法

中华半导体芯片的样本股按照以下方法选择：

（1）流动性甄选：样本股按照日均成交金额由高至低排名，保留日均成交金额排名前80%的股票；

（2）半导体芯片行业甄选：样本股的主营业务收入须来自半导体芯片材料、设备、设计、制造、封装或测试；

（3）市值甄选：剩余样本股按照日均市值由高至低排名，选取前50名作为指数样本。

日均成交金额（或日均市值）为：股票最近一年的日均成交金额（或日均市值） 新股为上市第四个交易日至审核截止日以来的日均成交金额（或日均市值）

3、样本股调整

（1）定期调整

中华半导体芯片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月的第二个星期五收盘后的下一交易日。样本调整设置缓冲区，排名在前40名的新样本优先进入，排名在前60名的老样本优先保留。

权重调整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，权重调整因子一般固定不变。

在每次样本股定期调整时，设置5只备选样本股作为备选名单。

（2）临时调整

在有特殊事件发生，以致影响指数代表性与可投资性时，将对中华半导体芯片样本将进行临时调整。发生临时调整时，由备选名单中排名最高的股票取代被剔除的股票。

## 科创50

1、样本空间

上证科创板50成份指数样本空间由满足以下条件的科创板上市证券（含股票、红筹企业发行的存托凭证）组成：

（1）上市时间超过6个月；待科创板上市满12个月的证券数量达100只至150只后，上市时间调整为超过12个月；

（2）上市以来日均总市值排名在科创板市场前5位，定期调整数据考察截止日后第10个交易日时，上市时间超过3个月；

（3）上市以来日均总市值排名在科创板市场前3位，不满足条件（2），但上市时间超过1个月并获专家委员会讨论通过。

存在以下情形的公司除外：

（1）被实施退市风险警示；

（2）存在重大违法违规事件、重大经营问题、市场表现严重异常等不宜作为样本的情形。

2、选样方法

（1）对样本空间内的证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后10%的证券作为待选样本；

（2）对待选样本按照过去一年的日均总市值由高到低排名，选取排名前50的证券作为指数样本。

3、样本调整

（1）定期调整（季调）

上证科创板50成份指数的样本每季度调整一次，样本调整实施时间为每年3月、6月、9月和12月的第二个星期五的下一交易日。每次调整数量比例原则上不超过10%。采用缓冲区规则，排名在前40名的候选新样本优先进入指数，排名在前60名的老样本优先保留。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。

上证科创板50成份指数定期审核时设置备选名单，具体规则参见指数计算与维护细则。当指数因为样本退市、合并等原因出现样本空缺或其他原因需要临时更换样本时，依次选择备选名单中排序靠前的证券作为样本。

（2）临时调整

特殊情况下将对上证科创板50成份指数样本进行临时调整。当样本发生退市时，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，参照指数计算与维护细则处理。

## 科创创业50

1、样本空间

中证科创创业50指数的样本空间由满足以下条件的科创板和创业板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来的日均总市值在沪深市场中排名前30位；

（2）非ST、\*ST证券。

2、选样方法

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前80%。

（1）对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取新一代信息技术产业、高端装备制造产业、新材料产业、生物产业、新能源汽车产业、新能源产业、节能环保产业、数字创意产业等新兴产业上市公司证券作为待选样本；

（2）将待选样本按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前50的证券作为指数样本。

3、样本调整

（1）定期调整（季调）

指数样本每季度调整一次，样本调整实施时间为每年3月、6月、9月和12月的第二个星期五的下一交易日。每次调整数量比例原则上不超过10%。采用缓冲区规则，排名在前40名的候选新样本优先进入指数，排名在前60名的老样本优先保留。

（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。

## 创业板指（国证指数）

1、样本空间

在深交所创业板上市交易且满足下列条件的所有A股：

（1）上市时间超过六个月，A股总市值排名位于深圳市场前1%的股票除外；

（2）公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；

（3）公司最近一年经营无异常、无重大亏损；

（4）考察期内股价无异常波动。

2、选样方法

创业板指数的初始样本股为发布日已纳入深证综合指数计算的全部创业板股票。

在创业板指数样本未满100只前，新上市创业板股票，在其上市后第十一个交易日纳入指数计算。

当创业板指数样本数量满100只后，样本数量锁定不再增加，以后需要对入围的股票进行排序选出样本股。

首先，计算入围选样空间股票在最近半年的A股日均总市值和A股日均成交金额；

其次，对入围股票在最近半年的A股日均成交金额按从高到低排序，剔除排名后10%的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年的A股日均总市值从高到低排序，选取前100名股票构成指数样本股。

在排名相似的情况下，优先选取行业代表性强、盈利记录良好的上市公司股票作为样本股。

3、样本调整

（1）定期调整

①考察期

指数样本股每半年调整一次。样本股考察期为半年，考察截止日为每年的4月30日和10月31日。每年5月份审核样本股时，参考依据一般是上一年度11月1日至审核年度4月30日的交易数据及财务数据；每年11月份审核样本股时，参考依据一般是审核年度5月1日至10月31日的交易数据及财务数据。

②调整时间

样本股定期调整于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实使。样本股调整方案通常在实施前两周公布。

③调整数量

每次样本股调整数量不超过样本总数的10%。

④缓冲区规则

排名在样本数70%范围之内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数130%范围之内的原样本股按顺序优先保留。

⑤备选样本股

在确定新入选成分股后，在剩余股票中按日均总市值从高到低排序选取样本数量5%的股票作为备选样本股。

（2）临时调整

略

## 创业板50（国证指数）

1、选样空间

创业板指数样本股。

2、选样方法

考察选样空间股票最近6个月的日均成交金额， 结合行业覆盖情况选取排名靠前的50只股票组成指数样本股。

3、样本股调整

（1）样本股定期调整

样本股定期调整定于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。

每次样本股调整数量不超过样本总数的10%。排名在样本数70%范围之内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数 130%范围之内的原样本股按顺序优先保留。

在确定新入选成份股后，在剩余股票中按选样指标从高到低排序选取样本数量5%的股票作为备选样本股，用于指数样本股定期调整之间的临时调整。

（2）样本股临时调整

样本股出现暂停上市或终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

样本股公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同深证成指。

## 国证芯片（国证指数）

1、选样空间

满足下列条件的所有A股：

（1）非ST、\*ST股票；

（2）上市时间超过六个月，或上市以来日均总市值排名在选样空间前3位，上市时间超过3个月；

（3）公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；

（4）公司最近一年经营无异常、无重大亏损；

（5）考察期内股价无异常波动；

（6）公司业务范畴属于芯片产业中材料、设备、设计、制造、封装和测试等。

2、选样方法

首先，计算入围选样空间股票在最近一年的A股日均成交金额和最近半年的 A 股日均总市值；

其次，剔除选样空间内最近一年的日均成交金额排名位于对应交易所后20%的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年的日均总市值从高到低排序，选取前 30 名股票作为指数样本股。

3、样本调整

（1）定期调整

指数样本股实施半年定期调整， 于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。

每次样本股调整数量不超过样本总数的20%。排名在样本数70%范围之内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数130%范围之内的原样本股按顺序优先保留。

在确定新入选样本股后，在剩余股票中按日均总市值从高到低排序选取样本数量5%的股票作为备选样本股。

（2）临时调整

样本股出现暂停上市或终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。样本股公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同国证1000指数。

## 生物医药（国证指数）

1、选样空间

在深圳证券交易所、上海证券交易所上市交易且满足下列条件的所有A股：

（1）有一定上市交易日期，一般为六个月；

（2）非ST、\*ST股票；

（3）公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；

（4）公司最近一年经营无异常、无重大亏损；

（5）考察期内股价无异常波动；

（6）公司业务领域属于生物医药产业

2、选样方法

首先，计算入围选样空间股票在最近半年的A股日均总市值和A股日均成交金额；

其次，对入围股票在最近半年的A股日均成交金额按从高到低排序，剔除排名后10%的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年的A股日均总市值从高到低排序，选取前30名股票构成国证生物医药指数样本股，数量不足则按实际数量选入。

3、样本调整

（1）定期调整

国证生物医药指数的样本股定期调整为半年定期调整，样本股定期调整于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。

先对入围股票进行选样指标排名，再按下列原则选股：

①排名在样本数70%范围之内的非原样本股按顺序入选；

②排名在样本数130%范围之内的原样本股按顺序优先保留；

③每次样本股调整数量不超过样本总数的20%。

在确定新入选成分股后，在剩余股票中按日均总市值从高到低排序选取样本数量5%的股票作为备选样本股，用于指数样本股定期调整之间的临时调整

（2）临时调整

略

## MSCI中国A50互联互通

1、样本空间（合格备选池包括母指数的所有成分股）

首先选择中国A股证券，然后剔除无法通过“互联互通”机制投资的中国A股证券。

2、选样方法

（1）本指数旨在纳入MSCI中国A股大盘股指数各个GICS®行业板块（“行业板块”）中自由流通调整市值最大的2只证券。

如果母指数的某些行业板块中没有证券被根据上述规则选出，则从备选池纳入这些行业中自由流通调整市值最大的证券。

（2）在按上文第1步选出证券之后，本指数纳入MSCI中国A股大盘股指数中自由流通调整市值最大的证券，直至证券数量达到目标成分股数量（50）。

3、样本调整

（1）定期调整（季度指数审查）

MSCI中国A50互联互通指数每季度调整一次，与分别在2月、5月、8月和11月进行的MSCI全球可投资市场指数指数审查同时进行，通常分别在2月、5月、8月和11月的最后交易日结束前。

预估指数一般在生效日期前9个交易日公布。

第1条至第2条所述的规则适用于每次季度指数审查。如果没有达到第（2）步所述的目标成分股数量，则将MSCI中国A股大盘股指数的所有剩余证券（在执行第（1）步之后）纳入本指数。

缓冲规则：

①为了减少指数换手率及增强MSCI中国A50互联互通指数的指数稳定性，在从各行业板块选出证券之后选择余下的证券时，设置了15只证券的缓冲规则。

②例如，在根据行业板块代表性选出22只证券之后，对于余下28只证券，缓冲规则适用于排名第13至第43的证券。MSCI中国A股大盘股指数中没有根据行业板块代表性选中且自由流通调整市值排名第13或以上的证券将按优先次序加入至MSCI中国A50互联互通指数。接着再将排名为第14至第43的现有成分股按顺序添加至指数中，直到MSCI中国A50互联互通指数的证券总数达到50只为止。若在完成此步骤后，证券总数尚不足50只，则将MSCI中国A股大盘股指数中的余下的证券依照排名由高至低的顺序添加至指数中，直到MSCI中国A50互联互通指数中的证券数量达到50只为止。

（2）临时调整（公司事件相关调整）

下一节将会简要介绍MSCI中国A50互联互通指数对常见公司事件的处理方法。

在两次指数审查之间，不会有新的证券纳入指数（下文所述情况除外）。对于以下注明的纳入情况，只有将证券添加到母指数后，该证券才会相应添加到指数中。

母指数的证券剔除将同时在本指数中反映。

详细事件处理方式，略

## 红利指数（年度更新，本次不更新）

1、样本空间

上证180指数的样本空间中满足以下条件的沪市A股和红筹企业发行的存托凭证

（1）过去一年日均总市值排名在前 80%

（2）过去一年日均成交金额排名在前 80%

（3）过去三年连续现金分红且过去三年股利支付率的均值和过去一年股利支付率均大于0且小于1。

2、选样方法

对样本空间内证券按照过去三年平均现金股息率由高到低排名，选取排名靠前的50证券作为指数样本。

3、样本调整

（1）定期调整

指数样本每年调整一次，样本调整实施时间为每年12月的第二个星期五的下一交易日。对原样本的样本空间资格设置缓冲区，即在新一轮样本调整中，将不满足以下任一条件的原样本从样本空间中剔除，剩余的原样本符合样本空间资格：

①过去一年现金股息率大于0.5；

②过去一年日均总市值排名落在上证180指数的样本空间前90%；

③过去一年日均成交金额排名落在上证180指数的样本空间前 90%；

④过去三年股利支付率均值大于0且小于1。

同时，设置调整比例限制，即 每次调整的样本比例一般不超过20%除非因不满足过去一年现金股息率大于0.5%而被剔除的原样本数量超过了20%。

（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。