

# 央视生态产业指数编制方案

为反映沪深北交易所生态环保产业上市公司的整体表现，向市场提供更丰富的指数化投资标的，编制央视生态产业指数。

## 一、代码与名称

指数名称：央视生态产业指数

指数简称：央视生态

英文名称：CCTV Ecology Industry Index

英文简称：CCTV Ecology

指数代码：399556

## 二、基日与基点

指数的基日为 2010 年 6 月 30 日，基点为 1000 点。

## 三、选样空间

满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证：

1. 非 ST、\*ST 证券；
2. 科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年；其他证券

上市时间超过 6 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. 考察期内证券价格无异常波动；
6. 公司业务范畴属于以下定义的产业领域：

一级产业	二级产业	一级产业	二级产业
清洁能源	风能	清洁材料	化工清洁材料
	太阳能		建筑节能材料
	核能		汽车清洁材料
	生物质能		储能材料
	天然气		生物降解材料
	水能		综合与其他
	综合与其他		
能源高效利用	发电侧节能	资源循环利用	再制造
	工业节能		再生资源综合利用
	智能节能建筑		矿产资源综合利用
	交通节能		餐厨废弃物资源化利用
	消费节能		农林废弃物资源化利用
	智能电网		水资源节约与利用
	综合与其他		综合与其他
污染物治理	大气处理	环境修复和生态保护	土壤修复
	水处理		荒漠治理
	固废处理		植树造林
	噪声处理		园林设计与建设
	环境监测仪器仪表		绿化工程
	综合与其他		生态旅游
			综合与其他

#### 四、选样方法

首先，计算入围选样空间证券在最近半年的日均总市值和

日均成交金额；

其次，剔除选样空间内最近半年的日均成交金额排名位于后 10% 的证券；

然后，对选样空间剩余证券按照最近半年的日均总市值从高到低排序，选取前 50 名证券构成初始样本。并限制属于同一个二级产业的证券最少入选 1 只，最多入选不超过 3 只。

## 五、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本权重调整”。

## 六、样本调整

### 1. 样本定期调整

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

每次样本调整数量不超过样本总数的 20%。排名在样本数 70% 范围内的非原样本按顺序优先入选，排名在样本数

130%范围内的原样本按顺序优先保留。

在确定新入选成份后，在剩余证券中按日均总市值从高到低排序选取样本数量 5%的证券作为备选样本。

## 2. 样本临时调整

样本出现终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

样本公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同央视财经 50 指数。

## 七、样本权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本的权重不超过 5%。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除样本在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进样本的权重调整因子。