

中小创新行业指数编制方案

为了反映深圳市场中小市值企业与创业创新企业的行业结构特征，进一步丰富行业指数体系，编制中小创新行业指数。

一、代码与名称

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
中小创新能源行业指数	中小能源	SZSE Small/Mid Cap Innovation Energy Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Energy	CN5122
中小创新原材料行业指数	中小材料	SZSE Small/Mid Cap Innovation Materials Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Materials	CN5123
中小创新工业行业指数	中小工业	SZSE Small/Mid Cap Innovation Industrials Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Industrials	CN5124
中小创新可选消费行业指数	中小可选	SZSE Small/Mid Cap Innovation Consumer Discretionary Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Consumer Discretionary	CN5125
中小创新主要消费行业指数	中小消费	SZSE Small/Mid Cap Innovation Consumer Staple Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Consumer Staple	CN5126
中小创新医药卫生行业指数	中小医药	SZSE Small/Mid Cap Innovation Health Care Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Health Care	CN5127
中小创新金融行业指数	中小金融	SZSE Small/Mid Cap Innovation Financials Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Financials	CN5128
中小创新信息技术行业指数	中小信息	SZSE Small/Mid Cap Innovation Information Technology Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Information Technology	CN5129
中小创新电信业务行业指数	中小电信	SZSE Small/Mid Cap Innovation Telecommunication Services Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Telecommunication Services	CN5130
中小创新公用事业行业指数	中小公用	SZSE Small/Mid Cap Innovation Utilities Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Utilities	CN5131

中小创新地产 行业指数	中小地产	SZSE Small/Mid Cap Innovation Estate Sector Index	SZSE Small/Mid Cap Innovation Estate	971002
----------------	------	--	---	--------

二、基日与基点

指数基日为 2011 年 12 月 30 日，基点为 1000 点。

三、选样空间

中小创新行业指数系列以中小创新指数样本股为样本空间。借鉴国际主流行业分类标准，并结合我国上市公司特点进行调整，将中小创新样本股按照国证行业分类标准分为 11 个一级行业，各一级行业与二级行业（三级行业）对应关系如下表所示。

一级行业	二级行业（三级行业）
能源	能源(能源设备与服务; 石油天然气; 煤炭; 可替代能源)
原材料	基础化工(化学原料; 化学制品; 农用化工; 合成纤维;); 基础材料(建筑材料; 容器与包装; 黑色金属; 有色金属; 非金属材料与制品; 纸类与林业产品)
工业	工业品(航空航天; 建筑产品; 电气部件与设备; 工业集团企业; 专用设备); 工业服务; 运输
可选消费	汽车与汽车零部件; 耐用消费品与服装; 纺织服务与奢侈品; 消费者服务; 媒体; 零售业
主要消费	食品与主要用品零售; 农牧渔产品; 家庭与个人用品
医药卫生	医疗保健设备与服务; 制药; 生物科技
金融	银行; 综合金融
信息技术	软件与服务; 技术硬件与设备; 半导体
电信业务	电信服务; 通信设备及技术服务
公用事业	公用事业(电力公用事业; 燃气公用事业; 复合型公用

	事业；水公用事业)
房地产	房地产服务；房地产开发和管理

四、选样方法

将中小创新样本股按国证行业分类标准进行分类，进入各自行业的全部股票形成相应行业指数的样本股。中小创新指数选样方法请参考中小创新指数编制方案。

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：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数})}$$

其中，样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则。

六、样本股调整

1. 样本股定期调整

同中小创新指数。每半年审核中小创新指数中的样本股，并根据审核结果调整中小创新各个行业指数中的样本股，调整时间为每年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。

2. 样本股临时调整

同中小创新指数。依据中小创新指数的临时调整，进行相对应的中小创新行业指数临时调整。