

中证光伏龙头 30 指数编制方案

中证光伏龙头 30 指数从沪深市场业务涉及光伏发电产业的上市公司证券中选取 30 只规模较大、盈利较好的证券作为指数样本，以反映光伏产业龙头上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证光伏龙头 30 指数

指数简称：光伏龙头 30

英文名称：CSI Photovoltaic Top 30 Index

英文简称：Photovoltaic Top 30

指数代码：931798

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

中证全指指数样本空间中沪深市场证券

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 90%。

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，选取主营业务涉及光伏发电产业的上市公司证券作为待选样本，业务范围包括但不限于硅片、太阳能专用加工设备、光伏玻璃、电池片、光伏玻璃、电池组件、逆变器、光伏支架和光伏电站等；

(2) 剔除过去三年累计扣非净利润为负且过去一年扣非净利润为负的待选样本；

(3) 对于剩余待选样本，分别计算主营业务收入、销售毛利率和 ROE 的升序排名，并用上述三个指标排名的算数平均数作为证券的综合得分，选取综合得分最高的 30 只证券作为指数样本，不足 30 只时全部纳入。

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，以使单个样本权重不超过 15%，且前五大样本合计权重不超过 60%。

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。