中证科技龙头指数编制方案

中证科技龙头指数从电子、计算机、通信、生物科技等科技领域中选取规模大、市占率高、成长能力强、研发投入高的 50 只上市公司证券作为指数样本，以反映科技领域内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：中证科技龙头指数

指数简称：科技龙头

英文名称：CSI Technology Top Index

英文简称：Technology Top

指数代码：931087

二、指数基日和基点

该指数以 2012 年 6 月 29 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

同中证全指指数的样本空间

2、选样方法

（1）将样本空间中归属于电子、计算机、通信、生物科技等科技领域的证券纳入科技主题空间;

（2）对科技主题空间中的证券进行稳定性筛选，剩余证券纳入备选空间:

➢剔除最新市盈率小于 0，或处于待选样本中最高的前 10%区间的证券;

➢剔除过去三年研发投入复合增长率为负的证券;

考虑部分科技领域上市公司自身发展周期的特殊性，对于营业收入(TTM)处于细分行业内前 10%的证券，不需要通过上述稳定性筛选，直接纳入备选空间;

（3）对备选空间的证券，分别按照过去一年日均总市值与营业收入(TTM)两个指标由高到低排名，将两项排名的算术平均由低到高排名作为综合排名，在细分行业内选取综合排名靠前的证券，合计选取 100 只作为待选样本。各细分行业证券数量按备选空间中该行业的证券数量占比进行分配;

（4）对待选样本分别按照最近报告期的营业收入增速与净利润增速两个指标由高到低排名，将两项排名的算术平均由低到高排名作为成长因子排名；再将待选样本按照最近年报研发支出总额占营业收入比例由高到低排名作为研发因子排名；将成长因子排名和研发因子排名的算术平均由低到高排名作为综合排名;

（5）在细分行业内选取综合排名靠前的证券，合计选取 50 只作为指数样本，各细分行业入选证券数量按待选样本中该行业的证券数量占比进行分配。

四、指数计算

指数计算公式为:

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

其中，调整市值 = Σ(证券价格 × 调整股本数 × 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 10%。

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。