

中证研发创新 100 指数编制方案

中证研发创新 100 指数从信息技术、通信、航空航天与国防、医药、乘用车及零部件等科技相关行业中选取研发营收比例高、行业代表性强的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映科技行业代表性上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证研发创新 100 指数

指数简称：创新 100

英文名称：CSI Innovation 100 Index

英文简称：Innovation 100

指数代码：931159

二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 6 月 30 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) 对样本空间内证券按照过去一年日均成交金额与过去三个月日均成交金额分别由高到低排名，并剔除排名均位于后 20% 的证券；

(2) 在剩余证券中选取符合科技空间定义的证券。科技空间指业务涉及信息技术、通信服务、航空航天与国防、电力设备、机械制造、医药卫生、乘用车

及零部件以及化学制品等科技相关领域的证券；

(3) 对上述科技空间证券进行研发强度筛选，剔除过去两年平均研发总支出占营业收入比小于 5% 的证券，将剩余证券作为待选样本；

(4) 在上述待选样本中，根据过去一年日均总市值、营业收入 (TTM)、毛利率 (TTM) 三个指标的综合排名，在各细分行业内选取排名靠前的证券，合计选取 100 只证券作为指数样本，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：

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

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 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。