

中证信息技术应用创新产业指数编制方案

中证信息技术应用创新产业指数选取不超过 50 只业务涉及基础硬件、基础软件、应用软件、信息安全、外部设备等细分领域的上市公司证券作为指数样本，反映信创产业上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证信息技术应用创新产业指数

指数简称：中证信创

英文名称：CSI Information Technology Application Innovation Industry Index

英文简称：CS IT Innovation

指数代码：931247

二、指数基日和基点

该指数以 2017 年 12 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、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 80%。

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，选取涉及基础硬件、

基础软件、应用软件、信息安全、外部设备等信息技术应用创新产业各细分领域的上市公司证券作为待选样本；

(2) 对上述待选样本，分别计算研发市值占比、净利润增速、营收增速、毛利率因子，并计算上述因子标准化 Z 值的算术平均值得到综合得分；

(3) 对上述待选样本，按各细分领域选取市值排名前三的上市公司证券优选作为指数样本；在剩余样本中，按综合得分由高到底排序，选取总计不超过 50 只上市公司证券作为指数样本。

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，以使样本采用综合得分调整后自由流通市值加权，单个样本权重不超过 5%。

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。