

中证长三角领先指数编制方案

中证长三角领先指数以长三角地区上市公司证券为待选样本，在医药卫生、电信和信息技术行业中，选取具备成长性特征的龙头上市公司证券作为指数样本；在其他行业中，选取具备蓝筹特征的证券作为指数样本，以反映长三角地区上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证长三角领先指数

指数简称：中证长三角

英文名称：CSI Yangtze River Delta Leading Index

英文简称：CSI Yangtze River Delta

指数代码：931381

二、指数基日和基点

该指数以 2012 年 12 月 31 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的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 对样本空间内剩余证券，选取所有注册地位于上海市、浙江省、江苏省和安徽省的上市公司证券作为待选样本；

(3) 从上述待选样本中，在各中证二级行业内，剔除过去一年营业收入或营业利润排名位于后 20% 的证券；

(4) 将剩余待选样本，按照中证一级行业划分为两类证券池。在医药卫生、通信服务和信息技术行业的证券池中，计算每只证券过去一年日均总市值、过去三年平均 ROE (TTM)、过去一年净利润增速、过去三年平均研发投入占营业收入比例等四项指标；在其他一级行业的证券池中，计算每只证券过去一年日均总市值、E/P (TTM) 和过去三年平均股息率等三项指标。在两类证券池中，分别按照上述指标降序排列得出百分比排名，将单项排名取算术平均并求倒数，得到待选样本综合得分；

(5) 根据两类证券池的剩余样本数量占比，分配两类证券池的最终入选样本数量。在每类证券池内，选取综合得分高的证券作为指数样本，确保指数样本数量为 150 只。

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市值加权且单个权重不超过 5%，综合得分调整市值等于样本综合得分与自由流通市值的乘积。

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。