

## 中证国新央企科技引领指数编制方案

中证国新央企科技引领指数由国新投资有限公司定制，主要选取国务院国资委下属业务涉及航空航天与国防、计算机、电子、半导体、通信设备及技术服务等行业的 50 只上市公司证券作为指数样本，以反映央企科技主题上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证国新央企科技引领指数

指数简称：央企科技引领

英文名称：CSI Guoxin Central-SOEs Technology Lead Index

英文简称：Central-SOEs Technology Lead

指数代码：932038

### 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

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，在属于国资委央企名录，以及实际控制权或第一大股东归属于国务院国资委的上市公司证券中，选取航空航天与国防、半导体、电子、计算机、通信设备及技术服务的上市公司证券作为科技主题证券；

(2) 选取同时满足以下条件的证券作为待选样本：

- 过去三年研发支出增速为正；
- 过去一年研发支出占营业收入比例不低于 3%；

过去一年研发支出在科技主题证券中排名前 50%的证券豁免上述条件。

(3) 对上述待选样本，分别计算过去一年日均总市值、过去一年研发支出占营业收入比例、过去一年营业收入增速、过去一年归母净利润增速的降序百分比排名，然后按照 10%、20%、30%、40%的权重将上述四项百分比排名加权平均计算得到综合得分；

(4) 根据综合得分由高到低进行排名，选取排名前 50 的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 10%，其中非国务院国资委或国资委下属中央企业实际控制的上市公司证券样本权重不超过 3%。

## 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。