

中国战略新兴产业成份指数编制方案

中国战略新兴产业成份指数选取节能环保产业、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造产业、新能源产业、新材料产业、新能源汽车产业、数字创意产业、高技术服务业等领域具有代表性的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映战略新兴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：中国战略新兴产业成份指数

指数简称：新兴成指

英文名称：China Strategic Emerging Industries Component Index

英文简称：Emerging Component Index

指数代码：000171

二、指数基日和基点

该指数以 2010 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

中国战略新兴产业综合指数样本且在上交所、深交所、北交所上市。

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券，剔除上市不满 3 个月的证券；

(2) 在剩余证券中，以中证全指样本过去一年日均成交金额、过去一年日

均总市值后 20%分位数作为阈值,剔除过去一年日均成交金额或过去一年日均总市值小于阈值后的证券作为待选样本;

(3) 在待选样本中,分别计算市值得分、营收增速得分和 ROE 得分,三项得分相加作为综合得分;

- 市值得分:按照过去一年日均总市值由高到低排名,排名百分位作为市值得分;
- 营收增速得分:在中证二级行业中按照过去一年营业收入增长率由高到低分别排名,排名百分位作为营收增速得分;
- ROE 得分:在中证二级行业中按照过去一年 ROE 由高到低排序分别排名,排名百分位作为 ROE 得分。

(4) 在待选样本中,按照综合得分由低到高排名,选取综合得分前 100 的证券作为指数样本。

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,以使指数以因子得分调整系数与自由流通市值乘积进行加权,且使单个样本权重不超过 10%。

因子得分调整系数计算方式如下:

将营收增速得分和 ROE 得分之和作为样本因子得分,按照因子得分排名分别给予 1、0.9、0.8、0.7 和 0.6 的因子得分调整系数。

因子得分（由低到高）	因子得分调整系数
前 20%	1
21%-40%	0.9
41%-60%	0.8
61%-80%	0.7
81%-100%	0.6

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。