

## 中证沪港深科技龙头指数编制方案

中证沪港深科技龙头指数从沪港深三地市场选取 50 只市值较大、市占率较高、研发投入较多的科技领域龙头上市公司证券作为指数样本，以反映沪港深市场科技龙头上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证沪港深科技龙头指数

指数简称：SHS 科技龙头

英文名称：CSI SH-HK-SZ Technology Top Index

英文简称：SHS Technology Top

指数代码：931524（人民币）/931524HKD（港元）

### 二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 11 月 14 日为基日，以 1000 点为基点。

### 三、样本选取方法

#### 1、样本空间

沪深市场：同中证全指指数的样本空间

香港市场：同中证港股通综合指数的样本空间

#### 2、选样方法

(1) 对样本空间内的沪深市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；对样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日

均成交金额不足 1000 万港元的证券；

(2) 对样本空间内剩余证券，选取通信设施、硬件设备、软件服务、互联网和医药等细分领域的上市公司证券作为科技主题空间；

(3) 在科技主题空间中，选取同时满足以下条件的证券作为待选样本：

- 第一大股东股权质押比例不高于 80% 且总质押比例不高于 50%；
- 过去两年公司总研发支出占总营业收入的比例在科技主题空间中排名前 90%；
- 市盈率的倒数大于 0 且在科技主题空间中排名前 90%；
- 研发投入大于 0 且过去三年研发投入的复合增长率为正；
- 在细分领域内，证券的净资产收益率（TTM）排名在前 50%；

在进行筛选时，对于营业收入（TTM）处于细分领域内前 10% 的证券，豁免上述后三条筛选条件；

(4) 根据剩余待选样本在各个细分领域的数量分布，确定各个细分领域拟选取样本数量，具体确定方法如下：

$$\text{第 } i \text{ 个细分领域样本数量 } N_i = \text{Max}(\text{round}(\frac{M_i}{\sum M_i} * 50), 3)$$

其中， $N_i$  表示各细分领域入选的样本数量，round 表示四舍五入取整； $M_i$  表示待选样本中该细分领域的证券数量；

(5) 在上述待选样本中，根据过去一年日均公司总市值和营业收入（TTM）两个指标分别计算升序百分比排名，将两项排名的算术平均值作为综合得分。在各细分领域内，依据已确定的样本数量选取综合得分较高的证券，若同一家公司的沪深市场证券和香港市场证券同时入选，则仅纳入市值较大的证券类别。若指数样本数量不足或超过 50 只，做进一步调整以使样本数量等于 50，同时保证各

细分领域入选证券数量不低于3只。

#### 四、指数计算

指数的计算公式为：

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

其中，调整市值 =  $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。汇率、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%，前五大样本权重合计不超过40%。

#### 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。当港股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时，指数将进行调整。