

# 中证创业成长指数编制方案

中证创业成长指数从创业板、原中小板以及部分主板市场中选取具备创业和高成长特征的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场创业和成长特征较为显著的中小型上市公司证券的整体表现。

## 一、指数名称和代码

指数名称：中证创业成长指数

指数简称：创业成长

英文名称：CSI Innovative and Growing Enterprises Index

英文简称：Innovative & Growing

指数代码：000958/399958

## 二、指数基日和基点

该指数以 2009 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

中证全指指数的样本空间中满足以下任一条件的上市公司证券：

(1) 属于创业板和原中小板的上市公司证券；

(2) 不属于中证 800 指数样本且过去一年日均总市值排名不在前 300 名的主板上市公司证券。

## 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，分别按照三年营业收入增长率、三年净利润增长率和净资产收益率由高到低排名，然后将三项排名之和由低到高排名作为证券的综合排名，选取综合排名靠前的 100 只证券作为指数样本。

## 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，以使单个样本权重不超过 10%。

## 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。定期调整设置缓冲区，排名在80名之前的新样本优先进入，排名在120名之前的老样本优先保留。

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。