

## 中证龙头企业指数编制方案

中证龙头企业指数基于行业成长性,在各行业内选取不同数量的头部上市公司证券作为待选样本,从中进一步选取规模和盈利能力靠前的50只证券作为指数样本,以反映沪深市场具有代表性的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: 中证龙头企业指数

指数简称: 中证龙头

英文名称: CSI Industry Top Index

英文简称: CSI Industry Top

指数代码: 931802

### 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90%。

#### 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,按照中证二级行业进

行分类，计算各行业最近三年营业收入复合增长率并由高到低排名，将排名前50%的行业作为高增长行业，剩余行业作为低增长行业；

(2) 在各行业内，按照过去一年的日均总市值、过去一年日均成交额、过去12个月营业收入(TTM)、过去12个月扣非归母净利润(TTM)、过去12个月销售毛利率(TTM)和最近三年平均ROE分别由高到低排名，并将排名之和由低到高排名作为综合排名，选取高增长行业综合排名靠前的5只证券作为待选样本，选取低增长行业综合排名靠前的2只证券作为待选样本；

(3) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值、过去一年日均成交额、最近三年平均ROE分别由高到低排名，并将排名之和由低到高排名作为综合排名，选取综合排名前50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，以使单个样本权重不超过15%，且前五大样本权重合计不超过60%。

#### 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。