

中证苏锡常发展主题指数编制方案

中证苏锡常发展主题指数从沪深市场中选取 80 只研发投入较高、成长性较好且符合产业转型升级方向的苏锡常地区上市公司证券作为指数样本，以反映苏锡常地区优质上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证苏锡常发展主题指数

指数简称：苏锡常指

英文名称：CSI Suzhou-Wuxi-Changzhou Development Index

英文简称：Suzhou-Wuxi-Changzhou Development

指数代码：931557

二、指数基日和基点

该指数以 2014 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

中证全指指数样本

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年日均成交金额由高到低进行排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 从剩余证券中选取注册地在苏州市、无锡市、常州市（包括各管辖县

级市) 的上市公司证券作为待选样本;

(3) 分别计算待选样本的过去一年日均总市值、业务转型升级得分、研发支出/营业收入和营业收入同比增长率并由高到低排名, 其中业务转型升级得分综合考虑上市公司产业特征、行业地位以及业务区域分布等因素得出。根据如下公式计算待选样本综合排名:

综合排名 = 60% × 日均总市值排名 + 20% × 业务转型升级得分排名 + 15% × 研发支出/营业收入排名 + 5% × 营业收入同比增长率排名

(4) 从上述样本中选择综合排名最高的 80 只证券作为指数样本。

四、指数计算

中证苏锡常发展主题指数的计算公式为:

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

其中, 调整市值 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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

中证苏锡常发展主题指数的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。