

中证交银理财长三角指数编制方案

中证交银理财长三角指数以长三角地区沪深 A 股为待选样本，在战略新兴企业中，选取市值较大、收入较高、研发投入较强的 40 只代表性股票；在非战略新兴企业中，选取盈利能力较强、估值较低、分红较高的 60 只代表性股票，共同构成样本股，以反映长三角地区代表性上市公司在 A 股市场的整体走势。

一、指数名称和代码

指数名称：中证交银理财长三角指数

指数简称：交银理财长三角

英文名称：CSI BOCOM Wealth Management Yangtze River Delta Index

英文简称：BOCOM WM Yangtze Delta

指数代码：931374

二、指数基日和基点

该指数以 2012 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

中证全指指数样本股

2、选样方法

(1) 对样本空间内股票按照最近一年的 A 股日均成交金额由高到低进行排名，剔除排名后 20% 的股票；

(2) 在剩余样本中，选取注册地位于上海市、浙江省、江苏省和安徽省的上市公司股票作为长三角待选样本；

(3) 从上述待选样本中，在各中证二级行业内，剔除过去三年 EBITDA/营业收入、过去三年营业费用/营业收入两项指标均排名后 10% 的股票；

(4) 根据上市公司主营业务是否属于战略性新兴产业，将剩余待选样本划分为战略新兴企业和非战略新兴企业。在战略新兴企业中，计算过去一年日均总市值、过去三年研发投入在营业收入中占比、过去三年平均营业收入等指标；在非战略新兴企业中，计算 E/P (TTM)、过去三年现金股利/过去三年日均总市值、过去三年平均 ROE (TTM) 等指标；

(5) 在战略新兴企业和非战略新兴企业剩余待选样本中，分别将上述指标标准化后取算术平均得到个股综合得分，再按照个股综合得分从高到低排序，分别选取排名靠前的 40 只和 60 只股票共同构成指数样本股。

四、指数计算

中证交银理财长三角指数的计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使单个二级行业样本权重合计不超过 10%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

中证交银理财长三角指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分

别为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。原则上，每次调整的样本比例一般不超过20%。

权重因子随样本股定期调整而调整，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。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。