

中证科技 50 指数编制方案

中证科技 50 指数从沪深两市科技相关行业中选取 50 只市值大、流动性好的公司股票作为样本股，以反映科技领域上市公司股票的整体表现，为指数化投资提供新的标的。

一、指数名称和代码

指数名称：中证科技 50 指数

指数简称：科技 50

英文名称：CSI Technology 50 Index

英文简称：Technology 50

指数代码：931380

二、指数基日和基点

该指数以 2014 年 6 月 30 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) 在剩余股票中选出属于如下中证行业分类的股票作为待选样本：中证一级信息技术与电信业务，中证四级航空航天与国防、新能源设备、医疗器械、医疗保健技术、生物科技、化学药、制药与生物科技服务、其他化学制品、塑料

制品、涂料涂漆、纤维及树脂、橡胶制品、印染化学品；

(3) 在待选样本中，剔除过去两年平均研发支出占营业收入比例小于 5% 的上市公司股票；

(4) 在 (3) 的基础上，剔除第一大股东质押比例大于 90%，或第一大股东质押比例大于 85% 且总质押比例大于 35% 的上市公司股票；

(5) 在 (4) 的基础上，依次选取最近年报或半年报中商誉占净资产比例小于 40% 的股票，最新年报中的研发资本化支出占研发支出比例在 50% 以下的股票；

(6) 在 (5) 的基础上，选取过去一年日均总市值最大的 50 只股票作为指数样本股。

四、 指数计算

中证科技 50 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，以使单个样本股权重不超过 10%。

五、 指数样本和权重调整

1、 定期调整

中证科技 50 指数每半年调整一次样本股，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。

定期调整时采用缓冲区规则，排名在前 40 名的候选新样本优先进入指数，

排名在前 60 名的老样本优先保留。定期调整指数样本时，每次调整数量比例一般不超过 10%。

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。