

## 中证迈格中国新经济指数编制方案

中证迈格中国新经济指数从可选消费、主要消费、医药卫生以及信息技术等行业选取 120 只基本面健康且兼具成长性的沪深 A 股上市公司作为指数样本股，采用等权的加权方式，以反映沪深两地市场符合新经济主题且基本面较为健康的上市公司整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证迈格中国新经济指数

指数简称：MG 新经济

英文名称：CSI MarketGrader China New Economy Index

英文简称：CSI MG New Economy

指数代码：930984

### 二、指数基日和基点

该指数以 2007 年 12 月 28 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) 根据中证一级行业分类标准，选取样本空间内归属于可选消费、必要消费、医药卫生以及信息技术行业的股票；同时针对样本空间内股票按照其调整日总市值进行降序排列，由高到低累加计算市值覆盖率，并指定市值覆盖率达到 85% 的股票组合为 A 组合；

(2) 对剩余股票，采用 MarketGrader 公司的评级打分系统从成长、价值、盈利以及现金流四个维度计算每只股票的综合评分并降序排列（分值介于 0 到 100，且分值越大代表公司基本面越健康）；

(3) 从可选消费、主要消费、医药卫生以及信息技术行业中分别选出综合评分最高的 30 只股票作为指数样本股；若选出的样本股无法同时满足以下条件，则按照行业内股票的综合评分由高到低进行替代：

(3.1) 调整日总市值不低于 14 亿人民币的股票；

(3.2) 过去 3 个月日均成交金额不低于 1400 万人民币的股票；

(3.3) 过去 12 个月成交总金额不低于 3.5 亿人民币的股票；

(3.4) 各行业所选股票至少有 20% 来自 A 组合；

(3.5) 过去 12 个月内公布季报或年报的股票；

(3.6) 非沪深交易所官网因境外投资者持股比例达到或超过 26% 而进行披露的股票。

#### 四、指数计算

中证迈格中国新经济指数计算公式为：

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

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、除数修正方法以及汇率参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使样本股权重相等。

#### 五、指数样本和权重调整

##### 1、定期调整

中证迈格中国新经济指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间为每年 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。当样本股的境外投资者持股比例达到或超过 28%而使港交所暂停该样本股的沪股通或深股通买入交易时，将其从指数样本中剔除。