

## 中证民企贡献指数编制方案

中证民企贡献指数选取沪深 A 股中代表性高、经济规模较大的 500 家民营上市公司股票作为样本股，以反映 A 股市场具有一定经济代表性的民营上市公司股票的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证民企贡献指数

指数简称：民企贡献

英文名称：CSI Private-owned Enterprises Contribution Index

英文简称：POEs Contribution

指数代码：931266

### 二、指数基日和基点

该指数以 2013 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

- (1) 中证全指指数样本股；
- (2) 中证民营企业综合指数样本股。

## 2、选样方法

(1) 对样本空间内股票，按照过去一年日均成交金额降序排列，剔除排名靠后 10% 的股票；

(2) 对剩余的股票，剔除质押比率在样本空间排名前 10% 的股票；

(3) 剔除最近一年扣除非经常性损益后的净利润为负的股票，剩余股票作为待选样本；

(4) 针对待选样本，计算经济贡献指标得分：

经济贡献指标计算方式为以下 4 个指标占待选样本股中所有股票这一指标总和的百分比，并计算 4 个指标的简单算术平均值，得到经济贡献指标得分。

营业收入：过去 3 个会计年度平均营业收入

所得税：过去 3 个会计年度平均所得税

研发支出：过去 3 个会计年度平均研发支出

雇员人数：最新年度报告公布的雇员总数

(5) 选取经济贡献指标得分最高的 500 只股票作为指数的样本股。

## 四、指数计算

中证民企贡献指数的计算公式为：

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

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, 以使指数样本股以经自由流通比例调整后的经济贡献得分加权, 且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

中证民企贡献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。

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。