

## 中证 500 成长估值指数编制方案

中证 500 成长估值指数从中证 500 指数中选取兼具预期净利润提升与低估值特性的上市公司证券作为指数样本，采用等权重加权方式计算，为投资者提供更多样化的投资标的。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证 500 成长估值指数  
指数简称：500 成长估值  
英文名称：CSI 500 Profit(E) Growth Index  
英文简称：CSI 500 Profit(E) Growth  
指数代码：930938

### 二、指数基日和基点

该指数以 2009 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 500 指数样本

#### 2、选样方法

(1) 剔除样本空间中预期净利润及预期净利润成长性综合指标为负的证券。预期净利润成长性综合指标包括预期净利润变化率指标与净利润超预期率指标。其中，预期净利润变化率指标为当前预期净利润超过一个季度前预期净利润的比率，净利润超预期率指标为已公告净利润超过同期预期净利润的比率；

(2) 将净利润预期成长性综合指标由高到低排名，选择排名靠前的不超过300只证券；

(3) 对剩余证券依据预期 PE 指标由低到高排名，最终选取预期估值最低的100只证券作为指数样本，若待选数量不足100只，则全部入选作为指数样本。

#### 四、指数计算

指数计算公式为：

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

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，以使所有样本权重相等。

#### 五、指数样本和权重调整

##### 1、定期调整

指数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。