

## 中证国企一带一路指数编制方案

中证国企一带一路指数以参与一带一路建设的国企上市公司为主要待选样本，从中选取企业盈利质量、成长能力与 ESG 等三个方面整体得分较高的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映受益于一带一路主题的国企上市公司证券在沪深市场的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证国企一带一路指数

指数简称：国企一带一路

英文名称：CSI SOEs along Belt and Road Index

英文简称：SOEs Belt and Road

指数代码：000859

### 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

中证 800 指数样本

#### 2、选样方法

(1) 从样本空间的国有企业上市公司或国有资本能施加重大影响的其它类上市公司中，选取在一带一路沿线国家或地区进行投资、并购、项目承建，或在一带一路沿线国家或地区进行进出口贸易，或在一带一路的国内沿线地区承担重

要基础设施建设及运营等职能的上市公司证券作为待选样本；

(2) 评估待选样本的盈利质量、成长能力和中证 ESG 评价得分，并对三个得分分别进行标准化处理，最后将三个标准化值以 40%、40%、20% 的权重求和得到单个证券的综合得分；

(3) 选取综合得分最高的 100 只证券作为指数样本，其中其它类上市证券不超过 20 只。

#### 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，以使指数以综合得分进行加权，且单个样本权重不超过 5%，其它类样本权重合计不超过 20%。

#### 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。每次调整的样本比例一般不超过 20%。样本调整设置缓冲区，排名在 80 名内的新样本优先进入，排名在 120 名之前的老样本优先保留。

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。