

中证企业核心竞争力 50 指数编制方案

中证企业核心竞争力 50 指数根据浙江财经大学中国金融研究院企业核心竞争力评价方法，从沪深市场中选取治理、财务、创新与社会责任四个方面得分靠前且市值较大的 50 只证券作为指数样本，为投资者提供多样化的投资标的。

一、指数名称和代码

指数名称：中证企业核心竞争力 50 指数

指数简称：企业核心竞争力 50

英文名称：CSI Enterprise Core Competitiveness 50 Index

英文简称：Enterprise Core Competitiveness 50

指数代码：931526

二、指数基日和基点

该指数以 2017 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

同中证全指指数的样本空间

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 在剩余证券中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前

30%的证券;

(3) 在剩余证券中, 根据浙江财经大学中国金融研究院企业核心竞争力评价方法, 计算治理、财务、创新与社会责任四个方面的得分, 选取在四个方面得分均排名前 50%的证券作为待选样本;

(4) 对待选样本按照过去一年日均总市值由高到低排名, 选取排名前 50 的证券作为指数样本。

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, 以使单个样本权重不超过 15%, 前五大样本权重合计不超过 60%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每年调整一次, 样本调整实施时间分别为每年 6 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。