

## 中证地方国有企业综合指数、中证地方国有企业 100 指数和 中证国有企业综合指数、中证国有企业 200 指数编制方案

中证地方国有企业综合指数选取所有地方国有上市公司证券作为指数样本，以反映地方国有上市公司证券的整体表现。

中证地方国有企业 100 指数选取最具代表性的 100 只地方国有企业上市公司证券为指数样本，以反映大型地方国有企业上市公司证券的整体表现。

中证国有企业综合指数由中证地方国有企业综合指数和中证中央企业综合指数样本组成，以反映国有企业上市公司证券的整体表现。

中证国有企业 200 指数由中证地方国有企业 100 指数和中证中央企业 100 指数样本组成，以反映大型国企上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
中证地方国有企业综合指数	中证地企	CSI Local State-owned Enterprises Composite Index	CSI L SOEs	000953/399953
中证地方国有企业 100 指数	地企 100	CSI Local State-owned Enterprises100 Index	CSI L SOEs 100	000954/399954
中证国有企业综合指数	中证国企	CSI State-owned Enterprises Composite Index	CSI SOEs	000955
中证国有企业 200 指数	国企 200	CSI State-owned Enterprises200 Index	CSI SOEs 200	000956/399956

### 二、指数基日和基点

该指数系列以 2009 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

中证地方国有企业综合指数样本空间由非 ST、\*ST 的 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成。

中证地方国有企业 100 指数样本空间为中证地方国有企业综合指数样本。

#### 2、选样方法

中证地方国有企业综合指数选取样本空间内所有地方国有企业上市公司证券作为指数样本。

中证地方国有企业 100 指数按照以下步骤选取具有代表性的 100 只地方国有企业上市公司证券作为指数样本：

(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) 对剩余证券按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名靠前的 100 只证券作为指数样本。

中证国有企业综合指数样本由中证地方国有企业综合指数和中证中央企业综合指数样本组成。

中证国有企业 200 指数样本由中证地方国有企业 100 指数和中证中央企业 100 指数样本组成。

### 四、指数计算

中证地方国有企业综合指数和中证国有企业综合指数计算公式为：

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

其中，调整市值 =  $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数})$ 。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。

中证地方国有企业 100 指数和中证国有企业 200 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 10%。

## 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。对于中证地方国有企业 100 指数，每次调整的样本比例一般不超过 10%，除非原样本因上市公司实际控制人变更导致调整比例超过 10%。定期调整设置缓冲区，排名在 80 名之前的新样本优先进入，排名在 120 名之前的老样本优先保留。

中证国有企业 200 指数样本随中证地方国有企业 100 指数和中证中央企业 100 指数样本的定期调整而随之调整。

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

对于中证地方国有企业综合指数、中证国有企业综合指数，上市以来日均总市值排名在上交所、深交所与北交所市场三市前 10 位的符合实际控制人属性要求的上市公司证券于上市满三个月后计入，其他符合实际控制人属性要求的上市

公司证券于上市满一年后计入。样本被实施风险警示措施的，从被实施风险警示措施次月的第二个星期五的下一交易日起将其从指数样本中剔除；被撤销风险警示措施的符合实际控制人属性要求的上市公司证券，从被撤销风险警示措施次月的第二个星期五的下一交易日起将其计入指数。

对于中证地方国有企业综合指数、中证国有企业综合指数、中证地方国有企业 100 指数、中证国有企业 200 指数，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。