

中证高端制造质量成长 50 指数编制方案

中证高端制造质量成长 50 指数选取成长性较高、盈利能力较强、现金流状况较好的高端制造领域上市公司证券作为指数样本，以反映高端制造领域优质上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证高端制造质量成长 50 指数

指数简称：高端造质量成长 50

英文名称：CSI High-End Manufacturing Quality Growth 50 Index

英文简称：High-End Manufacturing Quality Growth 50

指数代码：931718

二、指数基日和基点

该指数以 2014 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

同中证全指指数的样本空间

2、可投资性筛选

流动性要求：过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取信息技术、通信

设备、电力设备、航空航天与国防、机械制造、医药卫生、环保、汽车及零配件、油气开采等行业的上市公司证券作为待选样本；

(2) 对于待选样本，分别计算其细分指标得分，各因子得分等于细分指标得分的算术平均，待选样本综合得分等于因子得分的算术平均，剔除综合得分排名后 60% 的股票；

- 成长因子：净利润（TTM）同比增速，营业收入（TTM）同比增速
- 盈利因子：最近三年 ROE（TTM）均值，最近三年毛利率（TTM）均值
- 现金流因子：经营性净现金流（TTM）/总负债，经营性净现金流（TTM）/营业收入（TTM）

(3) 将剩余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 名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 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是每年 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。