

## 中证养老产业指数编制方案

中证养老产业指数选取 80 只涉及健康管理、休闲旅游、人寿保险等养老产业相关业务上市公司证券作为指数样本,反映养老产业相关上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称: 中证养老产业指数

指数简称: 养老产业

英文名称: CSI Old-Age Industry Index

英文简称: CSI Old-Age Industry

指数代码: 399812

### 二、指数基日和基点

该指数以 2004 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

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 80%。

#### 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,选取医药卫生、健康

食品、休闲旅游、人寿保险、小家电等养老产业相关上市公司证券作为待选样本；

(2) 对待选样本，优先选取各中证四级行业中过去一年日均总市值最大的上市公司证券作为指数样本；

(3) 在剩余待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名靠前的上市公司证券使得样本数量达到 80 只，且单个中证一级行业样本数量不超过 30 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。