

中证南方小康产业指数编制方案

中证南方小康产业指数从上证 180 指数样本中选取先进制造业、现代服务业和基础产业最具代表性的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映上证 180 指数中代表国民经济产业结构优化升级主要方向的上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证南方小康产业指数

指数简称：小康指数

英文名称：CSI Well-Off Index

英文简称：CSI Well-Off

指数代码：000901

二、指数基日和基点

该指数以 2005 年 12 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证 180 指数样本中剔除总市值最大的 20 只证券后的剩余证券。

2、选样方法

对样本空间内证券根据营业收入、现金流和净资产计算综合财务得分，然后按照综合财务得分由高到低排名，选取排名靠前的 100 只证券作为指数样本。

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，以使样本采用综合财务得分加权，且金融和房地产两个中证一级行业合计权重不超过 20%，其他单个中证一级行业权重不超过 20%，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。

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。