

中证杭州湾区指数编制方案

中证杭州湾区指数从环杭州湾区域选取 100 只流动性好、盈利能力高且兼具成长性的股票作为指数样本股，采用自由流通市值加权，以反映环杭州湾区域上市公司的整体表现。

一、 指数名称和代码

指数名称：中证杭州湾区指数

指数简称：杭州湾区

英文名称：CSI Hangzhou Bay Area Index

英文简称：Hangzhou Bay Area

指数代码：931033（人民币）

二、 指数基日和基点

该指数以 2009 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

中证杭州湾区指数的样本空间由满足以下条件的沪深 A 股构成：

- （1） 上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均 A 股总市值在全部沪深 A 股中排在前 30 位；
- （2） 非 ST、*ST 股票；
- （3） 非暂停上市股票。

2、 选样方法

（1） 对样本空间股票，按照过去一年日均成交金额降序排列，剔除排名靠后 20% 的股票；

(2) 选取注册地址在杭州、宁波、嘉兴、绍兴、湖州、舟山、金华、上海浦东、上海金山以及上海奉贤等城市和地区的上市公司；

(3) 对于注册地址在上海浦东、上海金山以及上海奉贤的上市公司，按照中证二级行业分类标准，剔除银行、保险、资本市场以及其他金融等行业上市公司；

(4) 剔除最近一期半年报、年报净利润为负的上市公司；

(5) 计算剩余股票的综合得分，具体计算公式如下：

$$\text{综合得分} = \sum \text{各指标降序排名} \times \text{指标对应权重}$$

其中，式中所采用的指标（若财务数据不满三年，采用已有年份数据）及其对应的权重分别为：

- a) 过去三年 ROE 均值：35%
- b) 过去三年销售收入增长率：35%
- c) 过去一年日均总市值：30%

(6) 对(5)中综合得分进行升序排列，选取排名靠前的 100 只股票作为指数样本股。

四、 指数计算

中证杭州湾区指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使指数样本股权重不超过 5%，同时满足上海地区样本股权重之和为 20%。

五、 指数样本和权重调整

1、 定期调整

中证杭州湾区指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整，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样本进行临时调整。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。