

# 中证农银乡村振兴指数编制方案

中证农银乡村振兴指数从沪深市场业务涉及农业生产、乡村建设、乡村消费升级等乡村振兴相关领域的上市公司证券中，选取净资产收益率较高、成长性较好的 100 只上市公司证券作为指数样本。

## 一、指数名称和代码

指数名称：中证农银乡村振兴指数

指数简称：农银乡村振兴

英文名称：CSI Nongyin Rural Revitalization Index

英文简称：Nongyin Rural Revitalization

指数代码：931225

## 二、指数基日和基点

该指数以 2016 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

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，选取业务涉及农业生

产、乡村建设、乡村消费升级等领域的上市公司证券作为乡村振兴主题证券；

(2) 对乡村振兴主题证券，剔除以下上市公司证券后，将剩余证券作为待选样本：

- 农业生产领域：过去两年净利润均为负；
- 其他领域：过去一年净利润为负。

(3) 对上述待选样本，分别计算过去两年加权 ROE、过去一年营业收入增速和过去一年归母净利润增速的降序百分比排名，然后按照 50%、25%、25% 的权重计算上述三项排名的加权平均值得到综合得分。其中，

$$\text{过去两年加权 ROE} = 0.6 \times \text{过去第一年 ROE} + 0.4 \times \text{过去第二年 ROE}$$

(4) 对农业生产和乡村建设领域的待选样本，分别选取综合得分最高的 40 只证券作为指数样本；对乡村消费升级领域的待选样本，选取综合得分最高的 20 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 =  $\sum$ (综合得分调整因子×证券价格×调整股本数×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，以使农业生产、乡村建设领域单个样本权重不超过 5%，乡村消费升级领域单个样本权重不超过 3%；农业生产、乡村建设领域权重上限与下限分别为 40%与 30%，乡村消费升级领域权重上限为 30%。

## 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。