

## 国证 2000 指数编制方案

为反映沪深北交易所小型证券的价格变动趋势，丰富市场研究工具、业绩比较基准和指数化投资标的，编制国证 2000 指数。

### 一、代码与名称

指数名称：国证 2000 指数

指数简称：国证 2000

英文名称：CNI 2000 Index

英文简称：CNI 2000

指数代码：399303

### 二、基日与基点

指数的基日为 2009 年 12 月 31 日，基点为 3326.4448 点。

### 三、选样空间

满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证：

1. 非 ST、\*ST 证券；
2. 科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年；其他证券

- 上市时间超过 6 个月；
3. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
  4. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
  5. 考察期内证券价格无异常波动。

#### 四、选样方法

首先，计算入围选样空间证券在最近半年的日均总市值和日均成交金额；

其次，对入围证券在最近半年的日均成交金额按从高到低排序，剔除排名后 10% 的证券；

然后，按日均总市值从高到低排序，扣除前 1000 只证券后，按照缓冲区技术选取排名靠前的 2000 只证券作为样本。

#### 五、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则。

#### 六、样本调整

##### 1. 样本定期调整

指数样本每半年定期调整，于每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本调整方案通常在实施前两周公布。

当国证 2000 指数样本数量达到 2000 只后，先对入围证券进行综合排名，每次样本调整数量不超过样本总数的 10%。排名在样本数 70% 范围之内的非原样本按顺序入选，排名在样本数 130% 范围之内的原样本按顺序优先保留。

在确定新入选成份样本后，在剩余证券中按选样指标从高到低排序选取样本数量 5% 的证券作为备选样本，用于指数样本定期调整之间的临时调整。

## 2. 样本临时调整

样本出现终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

样本公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同国证 1000 指数。