

国证 1000 指数编制方案

为反映沪深北交易所大中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 1000 指数。

一、代码与名称

指数名称: 国证 1000 指数

指数简称: 国证 1000

英文名称: CNI 1000 Index

英文简称: CNI 1000

指数代码: 399311

二、基日与基点

指数的基日为 2002 年 12 月 31 日,基点为 1000 点。

三、选样空间

满足下列条件的所有 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，总市值排名位于市场前 1% 的证券除外；
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，对选样空间剩余证券按照最近半年的日均总市值从高到低排序，选取前 1000 名证券作为指数样本。

在排名相似的情况下，优先选取行业代表性强、盈利记录良好的上市公司证券。

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、样本定期调整

1. 考察期

指数样本每半年调整一次。样本考察期为半年，考察截止日为每年的4月30日和10月31日。每年5月份审核样本时，参考依据一般是上一年度11月1日至审核年度4月30日的交易数据及财务数据；每年11月份审核样本时，参考依据一般是审核年度5月1日至10月31日的交易数据及财务数据。

2. 调整时间

样本定期调整于每年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。

3. 调整数量

每次样本调整数量不超过样本总数的10%。

4. 缓冲区规则

排名在样本数70%范围内的非原样本按顺序入选，排名在样本数130%范围内的原样本按顺序优先保留。

5. 备选样本

在确定新入选成分证券后，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。

七、样本临时调整

1. 快速入选规则

新上市证券若在上市后的 5 个交易日内，平均总市值排名位于市场前 10 名，则在上市 15 个交易日之后快速入选样本，同时从指数中剔除平均总市值排名最低的原样本。

上市公司因并购重组等行为，平均总市值排名进入市场前 10 名，参照新上市证券快速入选规则处理。

2. 收购合并

样本公司合并：合并后的新公司证券保留样本资格，产生的样本空缺由备选样本名单中排序最靠前的证券填补。

样本公司合并非样本公司：合并后的新公司证券保留样本资格。

非样本公司合并样本公司：若合并后的新公司证券排名高于备选样本名单中排序最靠前的证券，则新公司证券成为指数样本，否则，备选样本名单中排序最靠前的证券作为指数样本。

3. 分拆

样本公司分拆为多家新公司，新公司能否入选指数样本根据其排名而定：

若新公司证券的排名高于原样本中排名最低的证券，则该新公司证券入选指数样本。若入选数量超过 1 只，则剔除原样本中排名最低的证券，保持指数样本数量不变。

若新公司证券的排名全部低于原样本中排名最低的证券，但全部或部分公司证券的排名高于备选样本名单中排序最靠前的证券，则新公司证券中排名最高的证券入选指数样本。

若新公司证券的排名全部低于原样本中排名最低的证券，同时低于备选样本名单中排序最靠前的证券，则备选样本名单中排序最靠前的证券入选指数样本。

4. 终止上市

样本出现终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，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。

样本公司因重大违规行为（如财务报告造假），可能被终止交易的，经指数专家委员会审议后，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。

5. 实施风险警示

样本被交易所实施风险警示（ST 或*ST）的，从实施风险警示次月的第二个星期五的下一个交易日起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。

八、指数备选样本

在指数定期样本审核时，设置备选样本名单，用于指数样本定期调整之间的临时调整。

当指数出现样本退市、实施 ST 或 *ST 等事项需要临时更换样本时，依次选择指数备选样本名单中排序最靠前的证券作为样本。

备选样本数量一般为指数样本数量的 5%，备选名单随同定期调整名单向市场公布。当备选样本数量不足 50% 时，将及时补充并公告备选样本名单。