

## 巨潮规模指数系列编制方案

为反映沪深北交易所各规模板块证券的价格变动趋势，为投资机构提供投资标尺，丰富指数产品及金融衍生工具投资标的，编制巨潮规模指数系列。

### 一、代码与名称

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
巨潮大盘指数	巨潮大盘	CNI Large Cap.Index	CNI Large Cap.	399314
巨潮中盘指数	巨潮中盘	CNI Mid Cap.Index	CNI Mid Cap.	399315
巨潮小盘指数	巨潮小盘	CNI Small Cap.Index	CNI Small Cap.	399316
巨潮大中盘指数	大中盘	CNI Large-Mid Cap.Index	CNI Large-Mid Cap.	399400
巨潮中小盘指数	中小盘	CNI Mid-Small Cap.Index	CNI Mid-Small Cap.	399401

### 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

巨潮规模指数系列以国证 1000 指数样本为样本空间。

#### 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；  
其次，对选样空间证券按照最近半年的日均总市值从高到低排序，然后：

选取排名在前 200 名的证券，构成巨潮大盘指数样本；

选取排名在 201-500 名的证券，构成巨潮中盘指数样本；

选取排名在 501-1000 名的证券，构成巨潮小盘指数样本；

将巨潮大盘指数和巨潮中盘指数样本组合，构成巨潮大中盘指数样本，数量为 500 只；

将巨潮中盘指数和巨潮小盘指数样本组合，构成巨潮中小盘指数样本，数量为 800 只。

#### 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

指数按以下原则调整样本：

### 1. 巨潮大盘指数

首先，将选样指标排名在前 140 名的证券按顺序选入巨潮大盘指数样本；然后，将排名在 141 至 260 名之间的入围证券，根据原样本优先的原则按顺序补足样本，直至数量达到 200 只。

### 2. 巨潮中盘指数

巨潮大盘指数样本选定以后，按选样指标排名，前 210 名的证券按顺序入选巨潮中盘指数样本；然后选取排名在 211 至 390 名之间的入围证券，根据原样本优先的原则按顺序补足样本，直至数量达到 300 只。

### 3. 巨潮小盘指数

巨潮大盘、中盘指数样本选定以后，从余下公司中选取排名靠前的 500 只构成巨潮小盘指数样本。

### 4. 巨潮大中盘指数

巨潮大盘、中盘指数样本选定以后，组合巨潮大盘、中盘指数样本构成巨潮大中盘指数样本。

### 5. 巨潮中小盘指数

巨潮中盘、小盘指数样本选定以后，组合巨潮中盘、小盘指数样本构成巨潮中小盘指数样本。