

# 巨潮规模指数系列编制方案

(2019年2月修订)

为反映中国 A 股市场各规模板块股票的价格变动趋势，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。巨潮规模指数系列包括纯价格指数和全收益指数，纯价格指数通过深交所行情系统发布实时行情数据，全收益指数通过国证指数网发布收盘行情数据。

## 一、 代码与名称

指数代码	指数简称	指数中文名称	指数英文名称
399314	巨潮大盘	巨潮大盘指数	CNI LARGE CAP.INDEX
399315	巨潮中盘	巨潮中盘指数	CNI MID CAP.INDEX
399316	巨潮小盘	巨潮小盘指数	CNI SMALL CAP.INDEX
399400	大中盘	巨潮大中盘指数	CNI LARGE-MID CAP.INDEX
399401	中小盘	巨潮中小盘指数	CNI MID-SMALL CAP.INDEX

## 二、 基日与基点

指数基日为 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 指数样本股为样本空间。

#### 四、 选样方法

首先，计算入围选样空间股票在最近半年的 A 股日均总市值；其次，对选样空间股票按照最近半年的 A 股日均总市值从高到低排序，然后：

选取排名在前 200 名的股票，构成巨潮大盘指数样本股；

选取排名在 201-500 名的股票，构成巨潮中盘指数样本股；

选取排名在 501-1000 名的股票，构成巨潮小盘指数样本股；

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

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

#### 五、 指数计算

同国证 1000 指数。

#### 六、 样本股调整

指数按以下原则调整样本股：

##### 1. 巨潮大盘指数

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

## 2. 巨潮中盘指数

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

## 3. 巨潮小盘指数

巨潮大盘、中盘指数样本股选定以后，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股。

## 4. 巨潮大中盘指数

巨潮大盘、中盘指数样本股选定以后，组合巨潮大盘、中盘指数样本股构成巨潮大中盘指数样本股。

## 5. 巨潮中小盘指数

巨潮中盘、小盘指数样本股选定以后，组合巨潮中盘、小盘指数样本股构成巨潮中小盘指数样本股。

## 七、 指数的调整计算

同国证 1000 指数。

## 八、 指数的发布与管理

同国证 1000 指数。

## 九、 免责声明

同国证 1000 指数。