

国证公共服务指数编制方案

为了反映沪深北交易所中从事公共物品供给或者具有自然垄断特性的企业证券价格变动走势，编制国证公共服务指数。

一、代码与名称

指数名称：国证公共服务指数

指数简称：国证服务

英文名称：CNI Service Index

英文简称：CNI Service

指数代码：399320

二、基日与基点

指数的基日为 2004 年 12 月 31 日，基点为 1000 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；
 6. 从属行业具备自然垄断特征、具有公益性目标、市场进入和定价等行为受到政府管制的公司；或者其他具备公共产品或者准公共产品供给特征的公司。

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成交金额和日均总市值；

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 100 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、样本调整

1. 样本定期调整

指数样本实施半年定期调整，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。

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。

在确定新入选样本后，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。

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。