

国证皖江 30 指数编制方案

为了反映安徽省上市公司证券的整体表现, 凸显皖江城市带承接产业转移示范区的经济特征, 向市场提供区域投资的比较基准与标的, 编制国证皖江 30 指数。

一、代码与名称

指数名称: 国证皖江 30 指数

指数简称: 皖江 30

英文名称: CNI Wanjiang 30 Index

英文简称: CNI Wanjiang 30

指数代码: 399350

二、基日与基点

指数的基日为 2010 年 6 月 30 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. 公司注册地为安徽省。

四、选样方法

依据国证行业分类标准，将市场符合前述入围标准的证券划分至二级行业。使用过去两年平均营业收入、过去两年平均净利润、过去半年日均成交额和日均总市值四个指标对所有证券在二级行业内分别排名。将四项指标的排名结果相加，再以相加之和对证券在所属二级行业进行综合排名，选取在二级行业排名位于前50%的安徽上市公司证券作为指数备选样本。

备选样本中，每个二级行业排名第一的证券直接入选指数样本。选取在二级行业相对排名靠前的证券，补足样本数量至30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：

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子：见“七、样本权重调整”。

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20%。

在确定新入选成份证券后，在剩余证券中二级行业相对排名靠前的证券，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。

七、样本权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本在每次定

期调整时的权重不超过 10%。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除证券在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进证券的权重调整因子。