

国证三大经济圈指数编制方案

(2019年2月)

为了反映长江三角洲、珠江三角洲和环渤海地区三个经济圈的上市公司股票价格变动的总体趋势，编制国证三大经济圈系列指数。国证三大经济圈系列指数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：399355

指数简称：长三角

指数中文名称：国证长三角指数

指数英文名称：CNI YANGTZE INDEX

指数代码：399356

指数简称：珠三角

指数中文名称：国证珠三角指数

指数英文名称：CNI ZHUJIANG INDEX

指数代码：399357

指数简称：环渤海

指数中文名称：国证环渤海指数

指数英文名称：CNI BOHAI 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

在深圳证券交易所和上海证券交易所上市交易且满足下列条件的所有 A 股：

1. 非 ST、*ST 股票；
2. 有一定的上市时间，一般为六个月；
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. 考察期内股价无异常波动。
6. 长三角指数的入围公司注册地是苏浙沪毗邻地区的 16 个市组成的都市群。长三角城市包括：上海市；江苏省的 8 个市：南京、苏州、扬州、镇江、泰州、无锡、常州、南通；浙江省的 7 个市：杭州、宁波、湖州、嘉兴、舟山、绍兴、台州。
7. 珠三角指数的入围公司注册地是包括广州、深圳、珠海、佛山、江门、中山、东莞、惠州和肇庆市。
8. 环渤海指数的入围公司注册地为辽宁、河北、山东 3 省和北京、天津 2 市。

四、 选样方法

地区指数需要分别对入围后的股票进行排序选出样本股。

首先，计算入围选样空间股票在最近半年的 A 股日均总市值和 A 股日均成交金额；

其次，对入围股票在最近半年的 A 股日均成交金额按从高到低排序，剔除排名后 10% 的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年的 A 股日均总市值从高到低排序，选取前 40 名的股票分别构成长三角指数、珠三角指数和环渤海指数的样本股。

五、 指数计算

同国证 1000 指数。

六、 样本股调整

1. 样本股定期调整

长三角指数、珠三角指数和环渤海指数实施半年定期调整，样本股定期调整于每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。

长三角指数、珠三角指数和环渤海指数要先对入围股票进行综合排名，再按下列原则选股：

- (1) 排名在样本数 70% 范围内的非原样本股按顺序入选；
- (2) 排名在样本数 130% 范围内的原样本股按顺序优先保

留；

(3) 每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%；

在确定新入选成份股后，在剩余股票中按日均总市值从高到低排序选取样本数量 5% 的股票作为备选样本股，用于指数样本股定期调整之间的临时调整。

2. 样本股临时调整

(1) 样本股暂停上市的，从暂停上市日起，将相应样本股从指数计算中剔除，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(2) 样本股终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，将相应样本股从指数计算中剔除，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(3) 若样本股公司因重大违规行为（如财务报告重大造假）而可能被暂停或者终止交易的，将依据指数专家委员会的决定将其在指数样本中及时剔除，并选取备选样本股名单中排序最靠前的股票作为样本股。

(4) 样本股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，选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(5) 样本股公司发生收购、合并、分拆情形的处理，同国证 1000 指数。

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。