

国证基建指数编制方案

为反映沪深北交易所基建相关的上市企业的市场表现，丰富指数化投资标的，编制国证基建指数。

一、代码与名称

指数名称：国证基建指数

指数简称：国证基建

英文名称：CNI Infrastructure Index

英文简称：CNI Infrastructure

指数代码：399359

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. 从属于以下业务领域的公司：

业务范围	对应子行业	业务范围界定说明
电信	非传统电信运营商	
	综合电信业务	
	无线电信业务	
公用事业	电力公用事业	
	燃气公用事业	
	复合型公用事业	
	水公用事业	
能源	石油与天然气的储存和运输	
交通基本设施	机场服务	
	公路与铁路	
	海港与服务	
社会基础设施	教育服务	
	保健护理服务	
	保健护理机构	
建筑与工程	建筑与工程	包括市政建设；幕墙、装饰、室内施工除外

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，剔除选样空间内最近半年日均成交金额排名位后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50名证券作为指数样本。

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、分拆等情

形的处理，同国证 1000 指数。