巨潮中盘成长指数编制方案

为反映巨潮中盘指数样本中成长风格突出的上市公司的证券价格变化情况，丰富指数化投资工具，编制巨潮中盘成长指数。

一、代码与名称

指数名称：巨潮中盘成长指数
指数简称：中盘成长
英文名称：CNI Mid Cap. Growth Index
英文简称：CNI Mid Cap. Growth
指数代码：399374

二、基日与基点

指数基日为 2002 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

三、选样原则

巨潮中盘成长指数以巨潮中盘指数样本为样本空间。

四、选样方法

1. 计算因子得分

巨潮中盘成长指数的因子得分计算如下：

$$F = \frac{Z_R + Z_P + Z_{ROE}}{3}$$

Z_R、Z_P、Z_{ROE}分别表示最近 3 年平均主营业务增长率、最近 3 年平均净利润增长率和净资产收益率等指标在样本空间内的标准化 Z 值。其中，计算增长率变量 Z 值时，先对原始指标数据做上下 10%的缩尾处理，以减少极值对标准化结果的影响。

2. 指数选样

对样本空间按照因子得分从高到低排序，选取排名靠前的 100 只证券作为指数样本。

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

指数样本实施半年度定期调整，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%。排名在样本数 70%范围之内的非原样本按顺序入选，排名在样本数 130%范围之内的原样本按顺序优先保留。

在确定新入选样本后，在剩余证券中按成长因子得分从高到低排序，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。