

国证文化产业指数编制方案

为反映沪深北交易所文化产业上市公司的整体表现，凸显文化产业在国民经济中的重要地位，编制国证文化产业指数。

一、代码与名称

指数名称：国证文化产业指数

指数简称：国证文化

英文名称：CNI Culture Index

英文简称：CNI Culture

指数代码：399397

二、基日与基点

指数的基日为 2009 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. 公司业务范畴属于以下定义文化产业及细分领域：

文化产业	细分领域
新闻服务	新闻
出版印刷发行	图书；杂志；报纸；信息
广播电视电影	广播；电视；电影
网络新媒体	门户网站；电子商务；搜索引擎；网络视频；网络游戏；互联网服务
动漫游戏	动漫、游戏
广告	媒体广告
会展节庆	会展、节庆
旅游	旅行社；景区及景区服务；主题公园；旅游演艺
文化用品	文具；玩具；音像器材
专用软件	数字视频；通讯集成
创意设计	园林设计；工业设计
其他服务	艺术品经营服务；版权服务；商务代理服务
体育	体育活动
教育	教育培训
非物质文化遗产	特色中药；特色餐饮

四、选样方法

首先，计算入围选样空间在最近半年的日均总市值和日均成交金额；

其次，对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 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：

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

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。

每次调整的样本数量不超过 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。

七、样本权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本的权重不超过 5%。

权重调整因子每年调整 2 次，调整时间为样本定期调整实施日。以权重调整前倒数第 5 个交易日的收盘调整市值来计算权重调整因子。

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