

国证新能源汽车指数编制方案

为反映沪深北交易所新能源汽车产业上市公司的整体表现，为投资者提供更丰富的指数化投资标的，编制国证新能源汽车指数。

一、代码与名称

指数名称：国证新能源汽车指数

指数简称：新能源车

英文名称：CNI New Energy Vehicles Index

英文简称：CNI New Energy Vehicles

指数代码：399417

二、基日与基点

指数基日为 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. 公司业务领域属于新能源汽车产业，包括整车、电池材料、上游材料、电机电控、充电桩等。

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，剔除选样空间内最近半年的日均成交金额排名位于后 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

指数样本每半年调整一次，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，在剩余样本中按照选样指标从高到低排序选取样本数量 5% 的样本作为备选样本。

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 15%，前五大样本权重合计不超过 60%。

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。

当出现样本股临时调整时，新进样本股继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进股票的权重调整因子。