

## 国证数据要素主题指数编制方案

为反映沪深北交易所数据要素主题相关上市公司的整体表现，丰富指数化投资工具，编制国证数据要素主题指数。

### 一、代码与名称

指数名称：国证数据要素主题指数

指数简称：数据要素

英文名称：CNI Data Factor Index

英文简称：CNIDFI

指数代码：399418

### 二、基日与基点

指数基日为 2008 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. 公司业务涉及数据采集存储、数据加工分析、数据确权交易、数据安全、数据应用等数据要素相关领域。

#### 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，剔除最近半年日均成交金额排名后 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 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：

实时指数 = 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。

在未入选样本的证券中，按最近半年的日均总市值从高到低排序，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 指数。

## 七、样本权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使每次样本定期调整时，属于数据存储、数据加工分析、数据确权交易和数据安全等细分领域，且相关营收占比达 30% 以上的单只样本权重不超过 10%，其他领域的单只样本权重不超过 3%。

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。

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