

国证航天军工指数编制方案

为了反映A股市场上航天军工产品相关企业股票价格变动的趋势,编制国证航天军工指数。

一、代码与名称

指数名称: 国证航天军工指数

指数简称: 国证军工

英文名称: CNI Aerospace&Defense Index

英文简称: CNI Aerospace&Defense

指数代码: 399368

二、基日与基点

指数基日为 2004 年 12 月 31 日, 基点为 1000 点。

三、选样空间

在深圳证券交易所、上海证券交易所上市交易且满足下 列条件的所有 A 股:

1. 非 ST、*ST 股票;



- 2. 有一定上市交易日期,一般为六个月;
- 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. 考察期内股价无异常波动;
- 6. 业务领域涉及航天军工产品的公司。

四、选样方法

备选股数量达到 50 只之前,满足入围标准的股票均可 入选;

备选股数量超过50只之后,首先,计算入围选样空间股票在最近半年的A股日均总市值和A股日均成交金额;

其次,对入围股票在最近半年的 A 股日均成交金额按从 高到低排序, 剔除排名后 10%的股票;

然后,对选样空间剩余股票按照最近半年的 A 股日均总市值从高到低排序,选取排名在前 50 名的股票,构成国证航天军工指数样本股。

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

 $\times \frac{\sum ($ 样本股实时成交价×样本股权数×权重调整因子 $)}{\sum ($ 样本股上一交易日收市价×样本股权数×权重调整因子 $)}$



其中,样本股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、样本股权重调整"。

六、样本股调整

1. 样本股定期调整

样本股定期调整于每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。

每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%。排名在样本数 70%范围之内的非原样本股按顺序入选,排名在样本数 130%范围之内的原样本股按顺序优先保留。

在确定新入选样本股后,在剩余股票中按近6个月日均总市值从高到低排序选取样本数量5%的股票作为备选样本股。

2. 样本股临时调整

样本股出现暂停上市或终止上市时,将其从指数样本中剔除,选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

样本股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、样本股权重调整



在指数计算中,设置权重调整因子,使单只样本股在每次定期调整时的权重不超过15%,前五大权重股合计权重不超过60%。

权重调整因子每年调整 2 次,于样本股定期调整时实施。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。