

## 指数修订公告

为增强指数可投资性，深圳证券信息有限公司决定对存量指数进行修订。主要修订内容如下：

国证成长 100 指数。一是指数代码由 CN6014 修订为 980080，指数名称和简称分别修订为国证成长 100 指数和成长 100；二是选样空间修订为全部 A 股和红筹企业发行的存托凭证；三是选样方法修订为剔除选样空间日均成交额位于后 20%、日均总市值低于 50 亿元、净利润小于 0 的证券，剔除净资产收益率环比变化位于后 20%、单季度毛利率变化后 20% 的证券，按综合排名选取前 100 只证券；四是样本定期调整规则修订为每季度调整一次；五是缓冲区规则修订为每次样本调整数量不超过样本总数的 50%；六是权重调整规则修订为根据样本调整自由流通市值计算初始权重，使单只样本权重在每次定期调整时不超过 10%。

国证价值 100 指数。一是指数代码由 CN6027 修订为 980081，指数名称和简称分别修订为国证价值 100 指数和价值 100；二是选样空间修订为全部 A 股和红筹企业发行的存托凭证；三是选样方法修订为剔除选样空间日均成交额后 20%、日均总市值后 20%、净利润小于 0 的证券，剔除过去 12 个季度净资产收益率（TTM）平均值位于后 20%、过去 12 个季度净资产收益率波动率前 20%、自由现金流收益率后

50%的证券，按价值得分选取前 100 只证券；四是样本定期调整规则修订为每季度调整一次；五是缓冲区规则修订为每次样本调整数量不超过样本总数的 50%；六是权重调整规则修订为根据样本调整自由流通市值计算初始权重，使单个国证二级行业权重在每次定期调整时不超过 20%，单只样本权重不超过 8%。

本次修订将于 2024 年 10 月 29 日实施。修订后的编制方案见国证指数网（[www.cnindex.com.cn](http://www.cnindex.com.cn)）。

特此公告。

深圳证券信息有限公司

2024 年 10 月 25 日