

国证 2000 指数编制方案

(2015 年 1 月修订)

为反映A股市场小型股票的价格变动趋势，丰富市场研究工具、业绩比较基准和指数化投资标的，编制国证2000指数。国证2000指数包括纯价格指数和全收益指数，纯价格指数通过深交所行情系统发布实时行情数据，全收益指数通过国证指数网发布收盘行情数据。

一、 指数代码与名称

指数代码：399303

指数简称：国证 2000

指数中文全称：国证 2000 指数

指数英文名称：CNI 2000 INDEX

二、 基日与基点

国证 2000 指数以 2009 年 12 月 31 日为基日，基日指数为 3326.4448（即国证 1000 指数当日收盘点位）。

三、 选股原则

1. 入围标准

- (1) 在深圳证券交易所、上海证券交易所上市的 A 股；
- (2) 非 ST、*ST 股票；
- (3) 有一定上市交易日期（一般为六个月）；

- (4) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
- (5) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
- (6) 考察期内股价无异常波动；
- (7) 非国证 1000 指数样本股。

2. 选样方法

样本股选样指标为一段时期（前 6 个月）平均总市值的比重、平均自由流通市值的比重和平均成交金额的比重。选样时先计算入围个股平均总市值占市场比重、平均自由流通市值占市场比重和平均成交金额占市场比重，再将上述指标按 1: 1: 1 的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序，扣除国证 1000 指数样本股后，按照缓冲区技术选取排名靠前的 2000 只股票构成国证 2000 指数样本股。

在入围股票不足 2000 只时，选取所有符合入围标准的股票。

四、 指数计算方法

同国证 1000 指数。

五、 样本股调整

样本股每半年定期调整一次，于每年 1 月和 7 月的第一个交易日实施，通常在前一年的 12 月和当年的 6 月的第二个完整交易周的第一个交易日提前公布样本调整方案。

当国证 1000 指数调整样本股时，国证 2000 指数随之进行相应的样本调整。

当国证 2000 指数样本股数量达到 2000 只后，先对入围股票进行综合排名，再按下列原则选股：

- (1) 排名在样本数 70% 范围内的非原样本股按顺序入选；
- (2) 排名在样本数 130% 范围内的原样本股按顺序优先保留；
- (3) 每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%。

六、 指数的调整计算

同国证 1000 指数。

七、 指数的发布与管理

同国证 1000 指数。

八、 免责声明

同国证 1000 指数。