

巨潮规模指数系列编制方案

(2015年1月修订)

为反映中国A股市场各规模板块股票的价格变动趋势，为投资机构提供投资标尺，丰富指数产品及金融衍生工具投资标的，编制巨潮规模指数系列。巨潮规模指数系列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	指数简称	指数中文名称	指数英文名称
399314	巨潮大盘	巨潮大盘指数	CNI LARGE CAP.INDEX
399315	巨潮中盘	巨潮中盘指数	CNI MID CAP.INDEX
399316	巨潮小盘	巨潮小盘指数	CNI SMALL CAP.INDEX
399400	大中盘	巨潮大中盘指数	CNI LARGE-MID CAP.INDEX
399401	中小盘	巨潮中小盘指数	CNI MID-SMALL CAP.INDEX

二、 基日与基点

巨潮规模指数系列以2002年12月31日为基日，基日指数为1000。

三、 选股原则

1. 入围标准

巨潮规模指数系列以国证 1000 指数样本股为样本空间。

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，将计算结果从高到低排序，然后：

选取排名在前 200 名的股票，构成巨潮大盘指数样本股；

选取排名在 201-500 名的股票，构成巨潮中盘指数样本股；

选取排名在 501-1000 名的股票，构成巨潮小盘指数样本股；

将巨潮大盘指数和巨潮中盘指数样本股组合，构成巨潮大中盘指数样本股，数量为 500 只；

将巨潮中盘指数和巨潮小盘指数样本股组合，构成巨潮中小盘指数样本股，数量为 800 只。

四、 指数计算方法

同国证 1000 指数。

五、 样本股调整

指数按以下原则调整样本股：

1、巨潮大盘指数

首先，将选样指标综合排名在前 140 名的股票按顺序选入巨潮大盘指数样本股；然后，将排名在 141 至 260 名之间的入围股票，

根据原样本股优先的原则按顺序补足样本股，直至数量达到 200 只。

2、巨潮中盘指数

巨潮大盘指数样本股选定以后，按选样指标综合排名，前210 名的股票按顺序入选巨潮中盘指数样本股；然后选取排名在211至390名之间的入围股票，根据原样本股优先的原则按顺序补足样本股，直至数量达到300只。

3、巨潮小盘指数

巨潮大盘、中盘指数样本股选定以后，从余下公司中选取排名靠前的500只构成巨潮小盘指数样本股。

4、巨潮大中盘指数

巨潮大盘、中盘指数样本股选定以后，组合巨潮大盘、中盘指数样本股构成巨潮大中盘指数样本股。

5、巨潮中小盘指数

巨潮中盘、小盘指数样本股选定以后，组合巨潮中盘、小盘指数样本股构成巨潮中小盘指数样本股。

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。