

国证新能源汽车指数编制方案

(2014年9月)

为反映沪深两市新能源汽车产业相关上市公司的整体表现，向投资者提供更丰富的指数化投资标的，推进指数基金产品的开发，编制国证新能源汽车指数。

该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：399417

指数简称：新能源车

指数中文全称：国证新能源汽车指数

指数英文名称：CNI NEW ENERGY VEHICLES INDEX

二、 基日与基点

国证新能源汽车指数以2010年6月30日为基日，基日点位为1000点。

三、 样本股选样方法

1. 入围标准

(1) 在深圳证券交易所、上海证券交易所上市交易的A股；

- (2) 有一定上市交易日期，一般为六个月；
- (3) 非 ST、*ST 股票；
- (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) 公司业务领域属于新能源汽车产业，包括整车、电池材料、上游材料、电机和电控、充电桩等。

2. 选样方法

对满足入围标准的股票，先计算一段时期（一般为前六个月）个股平均总市值的比重、平均自由流通市值的比重和平均成交金额的比重，再将三个指标按 1: 1: 1 的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序，选取排名靠前的 50 只股票，构成国证新能源汽车指数样本股。

四、 指数计算方法

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 =

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

样本股：指纳入指数计算范围的股票。

样本股权数：为样本股的自由流通量，子项和母项的权数相同。

权重调整因子：见“六、样本股权重调整”。

分子与分母：分子项中的乘积为样本股经过权重调整后的实时自

由流通市值，分母项中的乘积为样本股经过权重调整后的上一交易日收市自由流通市值。

Σ 符号：是指对纳入指数计算的样本股经过权重调整后的自由流通市值进行汇总。

自由流通量：是上市公司实际可供交易的流通股数量，它是无限售条件股份剔除“持股比例超过 5% 的下列三类股东及其一致行动人所持有的无限售条件股份”后的流通股数量：① 国有（法人）股东；② 战略投资者；③ 公司创建者、家族或公司高管人员。

自由流通市值：股票价格乘以自由流通量。

股票价格选取：每个交易日集合竞价开市后用样本股的开市价计算开市指数，其后在交易时间内用样本股的实时成交价计算实时指数，收市后用样本股的收市价计算收市指数。样本股当日无成交的，取上一交易日收市价。样本股暂停交易的，取最近成交价。

五、 样本股调整

1. 样本股定期调整时间

样本股每年实施 2 次定期调整，调整时间为每年的 1 月与 7 月的第一个交易日，在实施前的两周内公布调整方案。

2. 样本股定期调整原则

- (1) 排名在样本数 70% 范围内的非原样本股按顺序优先入选；
- (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 20%。

3. 样本股临时调整

(1) 样本股暂停上市的，从暂停上市日起，将相应样本股从指数计算中剔除，并选择选样空间中排名最高的非样本股补足。

(2) 样本股终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，将相应样本股从指数计算中剔除，并选择选样空间中排名最高的非样本股补足。

(3) 若样本股公司因重大违规行为（如财务报告重大造假）而可能被暂停或者终止交易的，将依据指数专家委员会的决定将其在指数样本中及时剔除，并选取选样空间中排名最高的非样本股作为样本股。

(4) 样本股公司发生收购、合并、分拆情形的处理，同国证1000指数。

六、 样本股权重调整

1. 样本股权重限制

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本股的权重不超过5%。

2. 权重调整因子定期调整

权重调整因子每年调整 2 次，调整时间为样本股定期调整实施日。以权重调整前倒数第 5 个交易日的收盘调整市值来计算权重调整因子。

3. 权重调整因子临时调整

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，新进指数的股票继承被删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。

当样本股股本结构出现显著变化或者其它原因导致其权重发生突变时，或在其他特殊情况下，将决定是否对权重调整因子进行临时调整。

七、 指数的调整计算

同国证 1000 指数。

八、 指数的发布与管理

同国证 1000 指数。

九、 免责声明

同国证 1000 指数。