

弘毅远方基金管理有限公司

关于旗下指数基金标的指数相关信息的公告

根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》的相关要求，弘毅远方基金管理有限公司（以下简称“公司”）现将旗下弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金及弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金的标的指数的相关信息公示如下：

基金名称	标的指数	指数的基本信息及查询途径
弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金	国证民企领先100指数	指数代码：399362 编制机构：深圳证券信息有限公司 指数编制方案：请见附件一 查询途径：国证指数网 http://www.cnindex.com.cn/module/index.html?act_menu=1&indexCode=399362
弘毅远方国证消费100交易型开放式指数证券投资基金	国证消费100指数	指数代码：399364 编制机构：深圳证券信息有限公司 指数编制方案：请见附件二 查询途径：国证指数网 http://www.cnindex.com.cn/module/index.html?act_menu=1&indexCode=399364

风险提示：

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，了解基金产品的详细情况，选择与自身风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金产品进行投资。本公告的解释权归本基金管理人所有。

特此公告。

弘毅远方基金管理有限公司

2021 年 1 月 30 日

附件一、国证民企领先 100 指数编制方案

为反映A股市场上民营企业股票的价格变动趋势，丰富指数化投资标的，编制国证民企领先100指数。

国证民企领先100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、代码与名称

指数代码：399362

指数简称：民企100

指数中文名称：国证民企领先100指数

指数英文名称：CNI LEADING PRIVATE-OWNED ENTERPRISES 100

INDEX

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.上市时间超过六个月；
- 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.上市公司实际控制人为非国有独资、非国有控股及非外资控股。

四、选样方法

首先，对选样空间股票按照最近半年的A股日均成交金额从高到低排序，剔除排名后20%的股票；

其次，剔除大股东累计质押比超过85%的股票；

然后，剔除资产负债率超过70%的股票；

最终，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，选取前**100**名股票构成指数样本股。

五、指数计算

民企**100**指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样权数本股})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数})}$$

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，分子项和分母项的权数相同。

自由流通量：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。

分子项：为样本股实时自由流通市值之和。

分母项：为样本股上一交易日收市自由流通市值之和。

股票价格选取：以样本股集合竞价的开市价计算开市指数，以样本股的实时成交价计算实时指数，以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。

六、样本股定期调整

1.调整时间

指数样本股每半年调整一次。样本股定期调整于每年**6**月和**12**月的第二个周五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前一周公布。

2.调整数量

每次样本调整不设缓冲区，调整数量不设限制。

3.备选样本股

在确定新入选样本股后，在剩余股票中按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。

七、样本股临时调整

1.收购合并

样本股公司合并：合并后的新公司股票保留样本股资格，产生的样本股空

缺由备选样本股名单中排序最靠前的股票填补。

样本股公司合并非样本股公司：合并后的新公司股票保留样本股资格。

非样本股公司合并样本股公司：若合并后的新公司股票排名高于备选样本股名单中排序最靠前的股票，则新公司股票成为指数样本，否则，备选样本股名单中排序最靠前的股票作为指数样本。

2.分拆

样本股公司分拆为多家新公司，新公司能否入选指数样本根据其排名而定：

若新公司股票的排名高于原样本股中排名最低的股票，则该新公司股票入选指数样本股。若入选数量超过1只，则剔除原样本股中排名最低的股票，保持指数样本股数量不变。

若新公司股票的排名全部低于原样本股中排名最低的股票，但全部或部分公司股票的排名高于备选样本股名单中排序最靠前的股票，则新公司股票中排名最高的股票入选指数样本股。

若新公司股票的排名全部低于原样本中排名最低的股票，同时低于备选样本股名单中排序最靠前的股票，则备选样本股名单中排序最靠前的股票入选指数样本股。

3.暂停上市和退市

样本股暂停上市的，从暂停上市日起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。

样本股终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，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。

样本股公司因重大违规行为（如财务报告造假），可能被暂停或者终止交易的，经指数专家委员会审议后，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。

4.实施风险警示

样本股被交易所实施风险警示（ST或*ST）的，从实施风险警示次月的第二个周五的下一个交易日起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。

附件二、国证消费100指数编制方案

为反映A股市场中消费主题上市公司的市场表现，并为投资者提供更丰富的指数化投资工具，编制国证消费100指数。国证消费100指数通过深交所行情系统发布实时行情数据。

一、代码与名称

指数名称：国证消费100指数

指数简称：消费100

英文名称：CNI Consumer 100 Index

英文简称：CNI Consumer 100

指数代码：399364

二、基日与基点

指数的基日为2004年12月31日，基点为1000点。

三、选样空间

满足下列条件的所有A股：

- 1.非ST、*ST股票；
- 2.公司上市超过三年；
- 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.国证行业分类下，一级行业为可选消费、主要消费、医药卫生、信息技术和电信业务，或三级行业为物流的所有公司。

四、选样方法

首先，剔除大股东累计质押比超过80%的股票；

然后，剔除近6月日均成交金额排名后20%的股票，选择近6月日均总市值排名前150的股票；

最后，根据单位资产税息折旧及摊销前利润、营业总收入和总市值排名，加权计算得到综合评分，并从低到高进行排序，结合公司治理、股权结构等，选取前100只股票构成样本股。

五、指数计算

消费100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=

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

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

指数样本股实施半年定期调整，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。

每次样本调整不设缓冲区，调整数量不设限制。在确定新入选样本股后，在剩余股票中按综合评分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的，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

1. 样本股权重分配

设置权重调整因子，使单只股票的权重不超过10%。

2. 权重调整因子定期调整

权重调整因子每年随样本股定期调整而调整，调整时间为每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日，以调整实施日前倒数第5个交易日的收盘调整市值来计算调整时的权重调整因子。

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。