沪深A股中，每天剔除ST、退市整理期、收盘价小于1、总市值最小的400支股票，加上涨跌停、停牌限制，一直等权

4.zz1000和hs300成分优化

zz1000成分优化时，主要考虑弹性，hs300成分优化考虑类红利和抱团效应，在市场风格转换时获取收益

可以从个股轮动考虑个股权重优化，也可从个股筛选入手，但考虑股数不宜过少，权重不宜过大