

创业板指数编制方案

(2014年1月)

为了反映深市创业板的特征，提供市场比较基准与投资标的，编制创业板指数。

一、 指数代码与名称

指数代码：399006

指数简称：创业板指

指数中文名称：创业板指数（价格）

指数英文名称：SZSE CHINEXT PRICE INDEX

指数代码：399606

指数简称：创业板 R

指数中文名称：创业板指数（收益）

指数英文名称：SZSE CHINEXT RETURN INDEX

二、 基日与基点

创业板指数以 2010 年 5 月 31 日为基日，基日指数为 1000。

三、 选股原则

1. 入围标准

- (1) 在深交所创业板上市交易的 A 股；
- (2) 有一定上市交易日期（一般为三个月，总市值和自由流通市

值综合排名位于创业板市场前 10 名的股票不受此限制)；

- (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。

2. 选样方法

创业板指数的初始样本股为发布日已纳入深证综合指数计算的全部创业板股票。

在创业板指数样本未满100只前，新上市创业板股票，在其上市后第十一个交易日纳入指数计算。

当创业板指数样本数量满100只后，样本数量锁定不再增加，以后需要对入围的股票进行排序选出样本股。

创业板指数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，计算结果从高到低排序，在参考公司治理结构、经营状况等因素后，按照缓冲区技术选取创业板指数样本股。

四、 指数计算方法

同深证 100 指数。

五、 样本股调整

1. 样本股定期调整方法

创业板指数在样本满 100 只后实施季度定期调整，实施时间定于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的第一个交易日，通常在实施日前一月的第二个完整交易周的第一个交易日公布调整方案。

样本股定期调整方法是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%。

2. 样本股临时调整方法

在创业板指数样本未满 100 只前，新上市的创业板股票在其上市后第十一个交易日纳入指数计算。

在创业板指数样本满 100 只后，样本股临时调整方法同深证 100 指数。

六、 指数的调整计算

同深证 100 指数。

七、 指数的发布和管理

同深证 100 指数。

八、 免责声明

同深证 100 指数。