

## 指数介绍

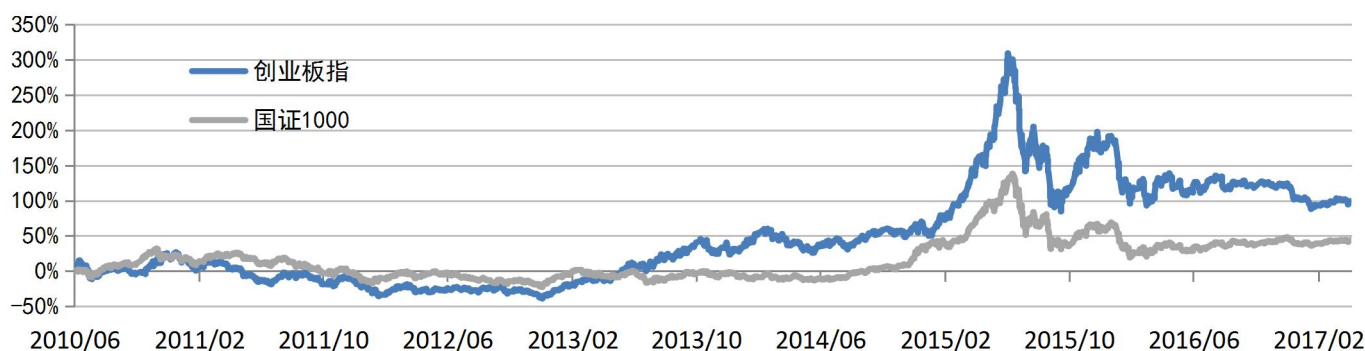
经过 8 年的发展,创业板市场已经聚集了一批中国市场高精尖企业,成为了中国资本市场服务经济转型的广阔平台,是全球服务创业历史最短而成长最快的市场。创业板指数是创业板市场的标尺指数,由创业板市场中市值规模最大、成交最活跃的 100 家上市公司组成,是投资者观测 A 股市场走势不可或缺的指标。

创业板指数行业结构与中国新经济转型方向高度一致,广泛覆盖新一代信息技术、数字创意产业、高端装备制造、节能环保等新兴行业,样本股中“九大战略新兴产业”权重占比高达七成。高成长性也是创业板指数的一大特色,样本股营业收入和净利润的复合增长率(2014 年至 2016 年)分别达到 35.63%和 42.62%,预期复合增长率(2016 年至 2019 年)为 31.79%和 28.80%。

## 指数构建

- 选择范围 在深交所上市交易超过 6 个月(总市值和自由流通市值综合排名位于深圳市场前 10 名的股票不受此限制)的非 ST、\*ST 股票,公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题、经营无异常和重大亏损,考察期内股价无异常波动。
- 选择指标 选择时先计算入围个股前 6 个月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。然后将计算结果从高到低排序,选取排名在前 100 名的 A 股构成初始样本股。

## 指数历史走势 (2010 年 6 月-2017 年 7 月底)



国证 1000 用以反映 A 股市场整体走势。

## 收益与波动 (日收益) (2017 年 7 月底)

指数	阶段收益				年化收益		年化波动率		夏普比率	
	1 个月	3 个月	1 年	今年以来	3 年	5 年	3 年	5 年	3 年	5 年
创业板指	-7.48%	-8.84%	-25.90%	-15.01%	8.86%	18.89%	37.02%	33.87%	2.49%	4.21%
国证 1000	2.81%	2.25%	4.03%	5.06%	17.10%	9.97%	28.58%	25.49%	4.26%	2.98%

## 分年度收益

指数	2016	2015	2014	2013	2012	2011
创业板指	-27.71%	84.41%	10.41%	95.25%	-0.37%	-35.88%
国证 1000	-15.46%	18.41%	47.21%	7.64%	9.10%	-26.84%

## 统计数据 (2017 年 7 月底)

权重 (%)		自由流通市值 (亿元)					基本面	
最大样本	最小样本	合计	最大	最小	均值	中位数	滚动 P/E	静态 P/E
7.13	0.22	972.17	69.30	2.18	9.72	7.13	38.00	37.88

国证行业分布 (2017 年 7 月底)

行业	样本数量	权重 (%)
信息技术	44	41.03
工业	20	21.82
医药卫生	13	10.39
主要消费	2	8.14
可选消费	8	6.83
电信业务	8	6.79
原材料	5	5.01
合计	100	100.00

战略新兴产业分布 (2017 年 7 月底)

战略新兴产业	样本数量	权重 (%)
新一代信息技术	28	22.96
数字创意产业	13	14.46
节能环保	7	9.67
高端装备制造	4	6.97
生物	8	6.78
新材料	4	5.76
新能源	4	2.37
高技术服务业	1	0.78
合计	73	72.61

十大权重股 (2017 年 7 月底)

样本	代码	权重 (%)	行业
温氏股份	300498	7.13	主要消费
乐视网	300104	3.34	信息技术
东方财富	300059	3.18	信息技术
信维通信	300136	2.74	电信业务
三聚环保	300072	2.53	原材料
碧水源	300070	2.44	工业
汇川技术	300124	2.42	工业
机器人	300024	2.30	工业
三环集团	300408	2.20	信息技术
乐普医疗	300003	1.75	医药卫生
总计		30.02	

指数资料

样本股数量	100
加权方式	真实自由流通市值
基点/基期	1000 点/2010 年 5 月 31 日
	每季度一次
	于 1 月、4 月、7 月和 10 月的第一个交易日正式实施, 于 12 月、3 月、6 月、9 月的第二个完整交易周的第一个交易日公布名单。
定期调整样本股	
计算频率	在深交所交易时段每 3 秒钟计算一次
发布日	2010 年 6 月 1 日

指数代码

指数	深交所	彭博	路透
深证创业板指数 (价格)	399006	SZ399006	.CHINEXTP
深证创业板指数 R (全收益)	399606	SZ399606	.CHINEXTTR

深证系列指数是深圳证券交易所的资产, 深圳证券交易所委托深圳证券信息有限公司负责深证系列指数的研发、运维和营销。未经深圳证券交易所和深圳证券信息有限公司的授权许可, 任何机构和个人都不得擅自使用深证系列指数用作任何商业用途, 包括但不限于用作投资组合的业绩比较基准或者产品的标的指数。

以上数据均来源于深圳证券信息有限公司, 仅作为信息参考, 深圳证券信息有限公司力求数据的正确, 但不保证数据的错误以及由于使用此公开材料所造成的商业损失承担任何责任。

指数历史表现并不作为未来收益的保证。

如欲知更详细的指数信息, 请访问 [www.cnindex.com.cn](http://www.cnindex.com.cn); 电邮 [index.services@cninfo.com.cn](mailto:index.services@cninfo.com.cn); 或致电 +86-755 8324 1251