

中小 300 指数编制方案

一、代码与名称

指数名称：中小企业 300 指数

指数简称：中小 300

英文名称：SZSE SME 300 Index

英文简称：SME 300

指数代码：399008

二、基日与基点

指数基日为 2010 年 3 月 19 日，基点为 1000 点。

三、选样空间

在深圳证券交易所原中小企业板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，A 股总市值排名位于深圳市场前 1% 的股票除外；
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。

四、选样方法

中小企业 300 指数的初始样本股从中小企业综合指数样本中选取指数发布前 10 个交易日日均流通市值排名靠前的 300 只非 ST 股票构成,以后需要对入围的股票进行排序选出样本股。

首先,计算入围选样空间股票在最近半年的 A 股日均总市值和 A 股日均成交金额;

其次,对入围股票在最近半年的 A 股日均成交金额按从高到低排序,剔除排名后 10%的股票;

然后,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 300 名股票构成指数样本股。

在排名相似的情况下,优先选取行业代表性强、盈利记录良好的上市公司股票作为样本股。

五、指数计算

指数采用派氏加权法,依据下列公式逐日连锁实时计算:

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

其中,样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则。

六、样本股调整

1. 样本股定期调整

指数样本股实施半年度定期调整,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。

每次样本股调整数量不超过样本总数的10%。排名在样本数70%范围内的非原样本股按顺序入选,排名在样本数130%范围内的原样本股按顺序优先保留。

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。

2. 样本股临时调整

样本股出现终止上市时,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,同深证成指。