

创业板 300 指数编制方案

为了进一步刻画创业板的规模特征，提供市场比较基准与投资标的，编制创业板 300 指数。

一、代码与名称

指数名称：创业板 300 指数

指数简称：创业 300

英文名称：SZSE ChiNext 300 Index

英文简称：ChiNext 300

指数代码：399012

二、基日与基点

指数的基日为 2012 年 6 月 29 日，基点为 1000。

三、选样空间

在深圳证券交易所创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 6 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

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：

实时指数 = 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。