

中小创新指数编制方案

为了反映深圳市场不同规模特征股票的整体表现，向市场提供更丰富的分析工具和业绩基准，编制中小创新指数。

一、代码与名称

指数名称：深证中小创新指数

指数简称：中小创新

英文名称：SZSE Small/Mid Cap Innovation Index

英文简称：SZSE Small/Mid Cap Innovation

指数代码：399015

二、基日与基点

指数基日为 2011 年 12 月 30 日，基点为 1000 点。

三、选股方法

在选取深证 1000 指数样本股中,剔除同期深证成指样本股之后的 500 只股票构成中小创新指数样本股。

四、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。

五、样本股调整

当深证成指、深证 1000 指数调整样本股时，中小创新指数随之进行相应的样本调整。