

创业板小盘 300 指数编制方案

为反映创业板市值规模较小、流动性较好的 300 家公司股价变化情况，丰富指数化投资工具，编制创业板小盘 300 指数。

一、代码与名称

指数名称：创业板小盘 300 指数

指数简称：创业小盘

英文名称：SZSE ChiNext Small Cap 300 Index

英文简称：CNTSMALL

指数代码：399020

二、基日与基点

指数基日为 2018 年 6 月 29 日，基点为 1000 点。

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；
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，剔除最近半年日均成交金额排名后 10% 的股票；
剔除创业板指数、创业板中盘 200 指数样本股以及最近半年日均总市值在样本空间前 210 名的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年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。

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% 范围之内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数 130% 范围之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，同创业板指。

当创业板指数、创业板中盘 200 指数调整样本股时，指数随之进行相应的样本调整。