

# 创业板大盘指数编制方案

为反映创业板市场具有良好流动性的优质大市值股票的整体表现，丰富指数化投资标的，编制深证创业板大盘指数。

## 一、代码与名称

指数名称：创业板大盘指数

指数简称：创业大盘

英文名称：ChiNext Large Cap Index

英文简称：ChiNext Large Cap

指数代码：399293

## 二、基日与基点

指数基日为 2012 年 12 月 31 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；
6. 公司业务领域属于新一代信息技术、高端装备制造、新材料、生物、新能源汽车、新能源、绿色环保、数字创意、高技术服务等战略性新兴产业；或为高新技术企业上市公司。

#### 四、选样方法

首先，选取 3 个月、12 个月年化交易量比率均大于 15% 的股票，其中年化交易量比率= $\Sigma$ （当月每天成交额中位数/月末自由流通市值）/月份数 $\times$ 12；

其次，剔除最新大股东累计质押比例超过 70% 的股票，剔除商誉占净资产比例超过 100% 的股票，剔除过去 3 年经营性现金流均为负的股票；

然后，剔除过去 3 个月实际交易天数占可交易天数比例低于 80% 的股票，剔除过去 12 个月连续停牌天数超过 50 天的股票；

最后，对选样空间剩余股票按照近 6 月日均总市值从高到低排序，选取前 50 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

$$\times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本股权重调整”。

## 六、样本股调整

### 1. 样本股定期调整

指数样本股实施半年定期调整，于每年6月和12月的第二个周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。

每次样本调整不设缓冲区，调整数量不设限制。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。

样本股公司发生收购、合并、分拆情形的处理，同创业板指。

## 七、样本股权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本股在每次

定期调整时的权重不超过 15%，前五大权重股合计权重不超过 60%。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本股定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本股临时调整时，新进样本股继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进股票的权重调整因子。