

国证 B 股指数编制方案

为了反映中国 B 股市场股票价格的整体变动趋势,以满足社会各界对中国证券市场股票价格动态信息的多方面需要,编制国证 B 股指数。

一、 指数代码与名称

指数代码: 399318

指数简称: 国证 B 指

指数中文全称: 国证 B 股指数

指数英文名称: CNI B SHARE INDEX

二、 基日与基点

国证 B 股指数以 2002 年 12 月 31 日为基日,基日指数为 1000。

三、 选股原则

国证 B 股指数的样本股为在深圳、上海证券交易所上市的除 ST、*ST 股票外的所有 B 股。

四、 指数计算方法

国证 B 股指数采用派氏加权法,依据下列公式逐日连锁实时计算:

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

样本股: 指纳入指数计算范围的股票。

样本股权数: 为样本股的自由流通量,子项和母项的权数相同。

分子与分母: 分子项中的乘积为样本股实时自由流通市值,分母项中的乘积为样本股上一交易日收市自由流通市值。

Σ: 是指对纳入指数计算的样本股自由流通市值进行汇总。

自由流通量: 是上市公司实际可供交易的流通股数量,它是无限售条件股份剔除“持股比例超过 5%的下列三类股东及其一致行动人所持有的无限售条件股份”后的流通股数量:①国有(法人)股东;②战略投资者;③公司创建者、家族或公司高管人员。

自由流通市值: 股票价格乘以自由流通量。

股票价格选取: 价格按上一交易周最后一个交易日国家外汇管理局公布的港币、美元兑人民币中间价折算成人民币。每个交易日集合竞价开市后用样本股的开市价计算开市指数,其后在交易时间内用样本股的实时成交价计算实时指数,收市后用样本股的收市价计算收市指数。样本股当日无成交的,取上一交易日收市价。样本股暂停交易的,取最近成交价。

五、 样本股调整

国证 B 股指数成份股对于涉及样本变动的事项实施实时调整，调整规则如下：

1. 对于新上市 B 股，于其上市后的第 11 个交易日将该新股纳入指数计算。

2. 被实施撤销特别处理的 B 股，在实施特别处理日从指数中剔除。

3. 被撤销特别处理的 B 股，在撤销特别处理日纳入指数计算。

4. 暂停上市的 B 股，从暂停上市之日起，从指数计算中剔除。

5. 终止上市的 B 股，从进入退市整理期的第一个交易日起，从指数计算中剔除。

六、 指数的调整计算

1. 调整母项中某成份股的上一交易日收市价

当上市公司进行派息、送股、配股、转增或其他除权情况，在除权除息日将母项中该样本股的股权登记日收市价更新为除权参考价。除权参考价以深圳和上海证券交易所发布的数据为准。

2. 调整子项和母项中某成份股的权数即 B 股自由流通量

同国证 1000 指数。

3. 汇率变动

美元和港币兑人民币汇率于每一交易周最后一个交易日收市后更新，数据取自国家外汇管理局当日公布的人民币汇率中间价。

七、 指数的发布与管理

同国证 1000 指数。

八、 免责声明

同国证 1000 指数。