

中小企业 100 指数编制方案

一、代码与名称

指数名称：中小企业 100 指数

指数简称：中小 100

英文名称：SZSE SME 100 Index

英文简称：SME 100

指数代码：399005

指数名称：中小企业 100 全收益指数

指数简称：中小 100R

英文名称：SZSE SME 100 Total Return Index

英文简称：SME 100 TRI

指数代码：399333

二、基日与基点

指数的基日为 2005 年 6 月 7 日，基点为 1000 点。

三、选样空间

在深圳证券交易所原中小企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. 上市时间超过六个月，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

中小企业 100 指数的初始样本股由前 100 只上市股票构成。此后需要对入围的股票进行排序选出样本股。

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 100 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

中小企业 100 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。

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

样本股出现暂停上市或终止上市时，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。