

## 创业板基础市场指数编制方案

为了反映创业板上市证券价格的综合变动情况以及市场总体走势，向投资者提供更丰富的分析工具和可交易指数产品标的，采用市值覆盖目标方法，编制创业板基础市场指数。

### 一、代码与名称

指数名称：创业板基础市场指数

指数简称：创业基础

英文名称：SZSE ChiNext Prime Market Index

英文简称：ChiNext Prime Market

指数代码：399640

### 二、基日与基点

指数基日为 2010 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. 上市时间超过一年；
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，计算创业板证券市场 A 股最近半年日均成交金额，剔除日均成交金额排名后 5% 的股票。

然后，在创业板市场中，按照最近半年日均总市值由大到小排序依次选入指数，直至累计市值达到创业板市场样本空间总市值的 85%。

#### 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：

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

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

创业板基础市场指数实施定期调整，时间定于每年 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。

样本股定期调整方法是先对入围股票按照平均总市值排名，再按下列原则选股：

首先，取累计市值达到 85% 的备选样本股最小平均总市值作为临界值，分别以该值为基础计算缓冲区上界和下界；

其次，依次选入平均总市值大于缓冲区上界的备选股票；

然后，依次选入平均总市值介于缓冲区上、下界之间的原样本股，若累计市值覆盖率达到 85% 则停止选入；

最后，若累计市值覆盖率仍未达到 85%，按照平均总市值依次选入新样本股，直至累计市值覆盖率达到 85%。

## 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。

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。