

深证次新股指数编制方案

为反映深市次新股的整体运行情况，向投资者提供更丰富的指数化投资标的，编制深证次新股指数。

一、代码与名称

指数名称：深证次新股指数

指数简称：深次新股

英文名称：SZSE Secondary New Share Index

英文简称：SZSE Secondary New Share

指数代码：399678

二、基日与基点

指数基日为 2010 年 12 月 31 日，指数基点为 1000 点。

三、选样方法

指数的样本选取按照以下规则：

1. 在深圳证券交易所上市交易的 A 股；
2. 股票上市交易天数不少于 45 个交易日，且不超过一年。

四、指数计算

深证次新股指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

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

其中，样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则。

五、样本股调整

深证次新股指数对于涉及样本变动的事项实施实时调整，调整规则如下：

1. 对于新上市的 A 股，如其符合选样原则，则于上市后第 45 个交易日将该股票纳入指数计算。

2. 如样本股上市满一年，则从上市一年后的第一个交易日起，将相应的样本股从指数计算中剔除。如果样本调整后，指数样本股个数低于 100 只，则暂停样本股剔除。

3. 样本股终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，将相应样本股从指数计算中剔除。

4. 若样本股公司因重大违规行为（如财务报告重大造假）而可能被暂停或者终止交易的，将依据指数专家委员会的决定将其在指数样本中及时剔除。

5. 样本股公司发生收购合并的，合并后的新公司股票保留样本股资格。

6. 一家样本股公司分拆为两家或多家公司的，分拆后的新公司股票入选指数样本股。