

中小企业板指数编制方案

为了提供可交易的指数产品和金融衍生工具的标的物，体现深市多层次资本市场的特征，反映中小企业板股票价格的总体走势，参照深证系列指数的编制方法和国际惯例，编制中小企业板指数。

一、总则

1. 指数名称：中小企业板指数；指数简称：中小板指；英文名称：SSE SME COMP. INDEX；
2. 指数代码：399101；
3. 指数样本：在深圳证券交易所中小企业板上市并正常交易的全部股票。

二、计算方法

（一）基日

中小企业板指数以 2005 年 6 月 7 日为基日，基日指数为 1000。

（二）计算公式

中小企业板指数采用派氏加权法编制，采用下列公式逐日连锁实时计算：

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

在上述公式中，子项和母项中同一样本股的权数相同，为该样本股的最新自由流通股数。子项中的乘积是样本股的实时流通市值，母项中的乘积是样本股的上一交易日收市流通市值， Σ 是指对纳入指数计算的样本股的流通市值进行汇总。

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。

三、调整计算

中小企业板指数的调整计算是根据不同情况，在开市前对指数实时计算公式中的有关数据项分别或同时进行调整。

1. 调整样本股的范围

即调整子项和母项中 Σ 的汇总范围，将某股票纳入（或剔除）指数的计算，包括：

（1）样本股暂停或终止上市的，从暂停或终止上市之日起，将相应样本股从指数计算中剔除；

（2）新上市股票于上市第 2 个交易日纳入指数计算。

2. 调整母项中某样本股的上一交易日收市价

指在某样本股的市场价格出现除权现象，当上市公司进行派现、送股、配股或转增时，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（除权参考价以深圳证券交易所的计算为准）；

3. 调整子项和母项中某样本股的权数即自由流通股数

（1）中小企业板指数采用自由流通股数进行加权计算；

（2）样本股公司进行权益分配，在送股、转增上市当日，根据实际送股、转增数量对相应样本股的权数进行修正；

（3）出现样本公司限制性流通股直接上市交易、样本股公司增资发行新股、样本股公司回购股份、样本股公司配股及导致样本股自由流通股数变化的其他情况的，对相应样本股权数进行定期修正。

四、维护和发布

1. 中小企业板指数由深圳证券交易所发布，委托深圳证券信息有限公司编制、维护和管理。

2. 中小企业板指数在交易时间内通过行情系统实时对外公布。收市指

数在每个交易日收市后通过中国证监会指定信息披露报刊和其他新闻媒体对外公布。

3. 中小企业板指数属于深圳证券交易所的资产，未经同意，任何单位或个人不得跟踪、交易该指数，或以该指数为评价基准。

4. 深圳证券交易所及深圳证券信息有限公司不承担中小企业板指数编制与发布过程中的任何错误和遗漏所导致的任何损失或责任。任何单位或个人因直接或间接使用该指数而导致的任何损失或责任均与深圳证券交易所和深圳证券信息有限公司无关。

深圳证券交易所
2005年11月29日