

北证专精特新指数编制方案

1、引言

北证专精特新指数从北京证券交易所（以下简称北交所）专精特新“小巨人”上市公司证券中选取市值最大的 50 只作为指数样本，以反映北交所专精特新上市公司证券的整体表现。

2、指数名称和代码

指数代码：899601

指数简称：北证专精特新

指数名称：北证专精特新指数

英文简称：BSE SRDI

英文名称：Beijing Stock Exchange SRDI Enterprises Index

3、样本选取方法

3.1 样本空间

北证专精特新样本空间由在审核截止日同时满足以下条件的北交所上市公司证券组成：

- 上市时间超过 6 个月，上市以来日均总市值排名在北交所市场前 5 名且发行总市值超过 100 亿元的除外；
- 非退市风险警示及其他风险警示类上市公司证券。

3.2 选样方法

北证专精特新按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、价格无明显异常波动或市场操纵的上市公司证券：

- 对样本空间内的证券按照过去六个月的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 30%的证券；
- 对上述符合流动性条件的证券，选取其中专精特新“小巨人”作为待选样本；
- 对待选样本按照过去六个月的日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 的证券，构成最新一期指数样本。

4、指数计算

4.1 基日与基点

指数以 2024 年 6 月 28 日为基日，基点为 1000 点。

4.2 指数计算公式

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = $\sum$ （证券价格 × 调整股本数 × 权重因子）。

调整股本数的计算方法、除数修正法参见指数计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%，前五大样本权重合计不超过 40%。

5、样本调整

5.1 定期调整

北证专精特新依据样本稳定性和动态跟踪相结合的原则，每半年审核一次样本，并根据审核结果调整指数样本。样本定期调整的参考依据为六个月日均数据。为有效降低指数样本周转率，北证专精特新样本每次调整数量比例一般不超过 20%，采用缓冲区规则，排名在前 40 名的候选新样本优先进入指数，排名在前 60 名的老样本优先保留。

为提高指数样本临时调整的可预期性和透明性，北证专精特新设置备选名单，用于样本定期调整之间发生的临时调整。备选名单中证券数量一般为指数样本数量的 10%。当备选名单中证券数量使用过半时，将及时补充并公告新的备选名单。

5.2 临时调整

样本临时调整参照北证指数计算与维护细则处理。