

## 新华区块链指数编制方案

为了反映区块链主题的投资价值，丰富指数化投资工具，新华指数定期遴选出业务领域涉及区块链产业相关上市公司，构建了新华区块链指数。

### 一、代码与名称

指数名称：新华区块链指数

指数简称：新华区块链

英文名称：Xinhua Block Chain Index

英文简称：XH·Block Chain

指数代码：989002

### 二、基日和基点

指数的基日为 2016 年 8 月 31 日，基点为 1000 点。

### 三、样本空间

在深圳证券交易所、上海证券交易所上市交易且满足下列条件的所有 A 股：

- 非 ST、\*ST 股票；
- 上市时间超过三个月，科创板上市时间超过一年；
- 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
- 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
- 考察期内股价无异常波动。
- 涉及区块链产品、业务、平台的上市公司。

#### 四、选样方法

1. 计算入选样本空间股票过去六个月的日均成交额，剔除后 10%的上市公司股票；

2. 根据样本空间剩余股票的总市值及行业分类，计算行业权重并排序：

其中行业权重 1-3 位的行业中，选取总市值前 5 位入选成分；

行业权重 4-8 位的行业，选取总市值前 3 位入选成分，共计 30 只股票；

3. 在剩余样本空间中，计算股票日均总市值、营业收入同比增长率、PEG 以及研发费用占营业总收入百分比因子，并根据相应权重进行排序，选取靠前的 20 只股

票，形成最终成分股。

## 五、指数计算

新华区块链指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

实时指数 =

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

## 六、样本和权重调整

### 1. 定期调整

指数样本股每年进行两次定期调整，分别为 6 月、12 月第二个星期五的下一交易日。样本股调整方案通常在实施的前三个工作日公布。每次调整的样本比例一般不超过 30%。

样本设置缓冲区，排名在 35 名内的新样本优先进入指数，排名在 65 名之前的老样本优先保留。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本股定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。权重调整因子按自由流通市值进行加权，其中个股权重不超过 4%。

## 2. 临时调整

特殊情况下将对指数样本进行调整。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照相关方法进行处理。

当出现样本股临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，新进指数的股票一般情况下将继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的收盘权重，并据此计算新进股票的权重因子。

## 七、免责声明

新华区块链指数属于新华指数（北京）有限公司所有，未经书面许可，任何单位和个人不得跟踪、交易该指数，或以指数为评价基准。对任何直接或间接使用本文件及任何信息而造成的损失，包括但不限于因内容不准确、不完整而导致的损失，新华指数（北京）有限公司及其关联方无须承担任何法律责任。