

# 新华区块链指数编制方案

(2021 年 8 月)

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、指数名称与代码

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 BlockChain Index

英文简称：XH·BlockChain

指数代码：989002

## 二、指数基日与基点

指数的基日为 2016 年 8 月 31 日，基点为 1000 点。

## 三、指数样本空间

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的所有 A 股：

1. 非 ST、\*ST 股票；
2. 上市时间超过六个月；

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. 经过 NLP 技术遴选，涉及区块链产品、业务、平台等实体且统计热度值不小于 1。

#### 四、指数选样方法

1. 对入选样本空间的股票进行基本面筛选，保留最近一个季度  $roe > 1\%$  且资产负债率  $< 1$  的股票；

2. 对剩余股票的区块链概念热度值，进行当前季度减前一季度的差值计算，如上一季度对应股票未出现，则将当季热度值记为差值；

3. 选取热度差值排名较低的前 50 只股票构成样本股，数量不足 50 只则按实际数量选入。极端情况下，热度增值较小且相同的样本可能超过 50 只，则按最近一个季度  $roe$  排序，取其中  $roe$  较大的前 50 只构成样本股。

#### 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：

实时指数=

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

权重调整因子：见“七、样本股权重调整”

#### 六、样本股调整

1. 样本股定期调整

指数样本股每年进行三次定期调整，分别为5月、9月和11月的第五个交易日。样本股调整方案通常在实施的前三个工作日公布。

先对入围股票进行选样指标排名，再按下列原则选股：

(1) 排名在样本数130%范围内的原样本股保留；

(2) 在保留的原样本股不足50只的情况下，排名在样本数100%范围内的非原样本股按顺序入选，至满足样本股数量。

在确定新入选样本股后，将剩余股票按排名，取前5%的股票作为备选样本股，用于指数样本股定期调整之间的临时调整。

## 2. 样本股临时调整

样本股出现暂停上市或终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

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。

## 七、样本股权重调整

在定期调整时，设置权重调整因子，使单一公司在每次定期调整时的权重不超过8%。

权重调整因子每年调整3次，于样本股定期调整时实施。在下一个调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本股临时调整时，新进样本股继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进股票的权重调整因子。

## 八、免责声明

新华区块链指数指数属于新华指数（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。