

深证创新 100 指数编制方案

为反映深圳证券市场创新型、成长型企业的运行特征，丰富指数化投资标的，编制深证创新 100 指数。

一、代码与名称

指数名称：深证创新 100 指数

指数简称：深创 100

英文名称：SZSE Innovation 100 Index

英文简称：SZSE Innovation 100

指数代码：399088

二、基日与基点

指数的基日为 2012 年 12 月 31 日，基点为 1000。

三、选样空间

在深圳证券交易所上市交易且满足下列条件的所有 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.考察期内股价无异常波动；
- 6.公司属于战略性新兴产业。

四、选样方法

首先，剔除最近半年日均成交金额排名位于后 10%的股票，剔除商誉占净资产比率大于 60%的股票，剔除资产负债率大于 80%的股票，剔除国证 ESG 评级在 B 及以下的股票；

然后，对剩余股票计算研发强度、资本开支强度、专利总量、最新一季度收入同比增长率、最新一季度利润同比增长率，将 5 项指标按照股票所属行业进行归一化处理后相加，得到每只股票的综合得分；

最后，综合考察上市公司行业地位、指数覆盖面等因素，选取综合得分较高的 100 只股票作为指数样本股。

五、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁计算：

当日指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本股当日成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则，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

指数样本股每半年调整一次，于每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。

每次样本股调整数量不超过样本总数的 20%。排名在样本数 70% 范围之内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数 130% 范围之内的原样本股按顺序优先保留。

在未入选样本股的股票中，按选样指标从高到低排序，选取样本数量 5% 的股票作为备选样本股。

2. 样本股临时调整

样本股出现终止上市时，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

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本股在每次定期调整时的权重不超过 15%，前五大样本股权重合计不超过 60%。

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。

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。