

深证物联网 50 指数编制方案

为反映深圳证券市场上物联网产业相关公司的表现，丰富指数化投资工具，编制深证物联网 50 指数。

一、代码与名称

指数名称：深证物联网 50 指数

指数简称：物联网 50

英文名称：SZSE Internet of Things 50 Index

英文简称：SZSE IOT 50

指数代码：399285

二、基日与基点

指数的基日为 2012 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

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 6 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. 公司业务涉及物联网产业，包括但不限于物联网基础硬件、网络服务、连接管理平台、应用硬件等。

四、选择方法

首先，计算入围选择空间股票最近 6 个月的 A 股日均成交金额和 A 股日均自由流通市值；

然后，对入围股票在最近 6 个月的 A 股日均成交金额从高到低排序，剔除排名后 10% 的股票；

最后，对选择空间剩余股票按照近 6 个月日均总市值从高到低排序，选取前 50 名股票构成样本股，数量不足 50 只则按实际数量选入。

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 = 上一交易日收市指数

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

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

指数样本股实施半年度定期调整，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 10%。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。

在确定新入选样本股后，在剩余股票中按日均总市值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 10%。

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。