

深证创新指数编制方案

(2014年7月)

为了贯彻“十一五”规划关于建设创新型国家的精神，反映深圳证券交易所市场上创新型企业的发展，编制深证创新指数。深证创新指数包括纯价格指数和全收益指数，纯价格指数通过深交所行情系统发布实时行情数据，全收益指数通过巨潮指数网发布收盘行情数据。

一、 指数代码与名称

指数代码：399332

指数简称：深证创新

指数中文名称：深证创新指数

指数英文名称：SZSE INNOVATION INDEX

二、 基日与基点

深证创新指数以2002年12月31日为基日，1000为基点。

三、 选股原则

1. 入围标准

- (1) 在深圳证券交易所上市交易的符合自主创新原则的A股；
- (2) 非ST、*ST股票；
- (3) 有一定上市交易日期，一般为六个月；
- (4) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
- (5) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；

(6) 考察期内股价无异常波动；

2. 选样方法

(1) 根据自主创新原则挑选出符合标准的个股。自主创新原则定义为在国家优先发展的十大高新技术领域的原始创新、集成创新和引进消化吸收再创新或创新的商业模式，这十大领域主要包括：电子与信息技术领域、生物医药与农业技术领域、新型材料技术领域、新能源及高效节能技术领域、光机电一体化技术领域、医药与医学工程技术领域、环境保护技术领域、航空航天技术领域、地球、空间及海洋工程技术领域、核应用技术领域；

(2) 参考科技部及工信部有关创新型企业的最新统计口径，综合考虑上市公司财务情况、规范经营情况及二级市场股价波动情况，筛选样本股备选池；

(3) 按照深证系列指数的选股原则进行挑选，样本股选样指标为一段时期（前 6 个月）平均总市值的比重、平均自由流通市值的比重和平均成交金额的比重。选样时先计算入围个股平均总市值占市场比重、平均自由流通市值占市场比重和平均成交金额占市场比重，再将上述指标按 1: 1: 1 的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序，选取前 40 名构成深证创新指数初始样本股。

四、 指数计算方法

同深证 100 指数。

五、 样本股调整

1. 样本股定期调整方法

同深证 100 指数。

2. 样本股临时调整方法

(1) 样本股暂停上市的，从暂停上市日起，将相应样本股从指数计算中剔除，并选择选样空间中排名最高的非样本股补足。

(2) 样本股终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，将相应样本股从指数计算中剔除，并选择选样空间中排名最高的非样本股补足。

(3) 若样本股公司因重大违规行为（如财务报告重大造假）而可能被暂停或者终止交易的，将依据指数专家委员会的决定将其在指数样本中及时剔除，并选取选样空间中排名最高的非样本股作为样本股。

(4) 样本股公司发生收购、合并、分拆情形的处理，同深证 100 指数。

六、 指数的调整计算

同深证 100 指数。

七、 指数的维护和发布

同深证 100 指数。

八、 免责声明

同深证 100 指数。