

# 深证科技指数编制方案

为了反映深圳证券交易所市场上科技型企业股票价格变动的趋势，丰富指数化投资工具，编制深证科技指数。

## 一、代码与名称

指数名称：深证科技指数

指数简称：深证科技

英文名称：SZSE Technology Index

英文简称：SZSE Technology

指数代码：399339

## 二、基日与基点

指数基日为 2004 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. 科技型上市公司业务领域具体涵盖的范围主要包括信息、生物、航空航天、新材料、先进能源及新能源汽车、现代农业、先进制造、节能环保及资源综合利用、海洋、高技术服务等。

在满足 1-6 的入围条件后，参考科技部及工信部有关高科技企业的最新统计口径，确定入围样本股。

#### 四、选样方法

首先，计算入围选样空间股票在最近半年的 A 股日均总市值和 A 股日均成交金额；

其次，对入围股票在最近半年的 A 股日均成交金额按从高到低排序，剔除排名后 10% 的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年的 A 股日均总市值从高到低排序，选取排名在前 100 的股票，构成深证科技指数初始样本股。

#### 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：

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

其中，样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则。

## 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%范围内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数130%范围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。