

国证深圳创新示范 100 指数编制方案

为反映沪深北交易所深圳市上市企业的市场表现, 凸显深圳经济改革创新特色, 为市场提供深圳市上市企业的业绩基准与投资标的, 编制国证深圳创新示范 100 指数。

一、代码与名称

指数名称: 国证深圳创新示范 100 指数

指数简称: 创新示范

英文名称: CNI Shenzhen Innovation DEMO 100 Index

英文简称: Innovation DEMO

指数代码: 399351

二、基日与基点

指数基日为 2004 年 8 月 31 日, 基点为 864.38 点。

三、选样空间

在深圳证券交易所、上海证券交易所和北京证券交易所上市交易的深圳企业:

1. 非 ST、*ST 证券；
2. 科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年；其他证券上市时间超过 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. 考察期内证券价格无异常波动；
6. 信息披露、公司内控等方面治理规范。

四、选样方法

首先，对满足入围标准的证券，按照最近半年日均成交金额由高到低进行排名，剔除排名后 10% 的证券；

其次，对剩余证券，依据最近半年日均总市值、近三年平均研发费用、营业收入、净利润分别进行排名，然后加总得到总排名，选取排名最高的 100 只证券作为指数样本。

在排名接近的情况下，综合考虑公司所属行业的创新性、公司的行业代表性和经营治理情况，优先选取指标优良的上市公司证券作为样本。

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：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数}$$

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

其中，样本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、样本权重调整”。

六、样本调整

1. 样本定期调整

指数样本实施半年定期调整，于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本调整方案通常在实施前两周公布。

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

在确定新入选样本后，在剩余证券中按选样指标从高到低排序选取样本数量5%的证券作为备选样本。

2. 样本临时调整

样本出现终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

样本公司被实施风险警示、发生收购、合并、分拆等情形的处理，同国证1000指数。

七、样本权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本在每次样本定期调整时的权重上限不超过 10%，同时，国证行业分类下的一级行业权重不超过 30%。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除证券在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进证券的权重调整因子。