

科技 100 指数编制方案

为反映原中小板与创业板中具备高新技术和自主创新特征上市公司的整体运行情况，丰富指数化投资工具，编制科技 100 指数。

一、代码与名称

指数名称：深证科技 100 指数

指数简称：科技 100

英文名称：SME-ChiNext Tech 100 Index

英文简称：SME-ChiNext Tech 100

指数代码：399608

二、基日与基点

指数基日为 2007 年 06 月 29 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. 在原中小板或创业板上市，且具备高新技术或自主创新

特征；

2. 非 ST、*ST 股票；
3. 上市时间超过 6 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；

四、选样方法

1. 挑选出具备高新技术或自主创新特征的公司，根据以下两条原则挑选：

(1) 主要从事国家优先发展的高新技术领域。包括：电子与信息技术领域、生物医药与农业技术、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、核应用技术领域以及其他国家优先发展的高新技术领域；

(2) 具有创新的商业模式。在企业盈利或价值增值中，其运作方式具有较为独特的特性或具有垄断性，并能为其客户和自身创造价值。

2. 对具备高新技术或自主创新特征的公司进行评分：

计算上述公司的净资产收益率(过去 12 个月滚动计算)和主

营业务利润率（过去 12 个月滚动计算），将两项指标按 1:1 加权平均，将计算结果从高到低排序，选取排名前 90% 的股票构成备选样本股。

3. 选取备选样本股以后需要对入围的股票进行选择：

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，选取前 100 名股票构成指数样本股。

五、指数计算

科技 100 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。