

深证环保指数编制方案

为反映深圳证券市场中环保相关产业上市公司的总体股价变动趋势，编制深证环保指数。

一、代码与名称

指数名称：深证环保指数

指数简称：深证环保

英文名称：SZSE Environmental Protection Index

英文简称：SZSE Environmental Protection

指数代码：399638

二、基日与基点

指数基日为 2004 年 12 月 31 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. 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. 与环保设备制造、环保服务（减排、控制大气污染、消除噪声、处理废弃物及处理废水等活动）和清洁生产技术及清洁产品（新能源、清洁能源和可再生能源、节能产品、绿色农业等）相关的上市公司（具体见附件《环保行业划分标准》）。

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，选取前 40 名股票构成初始样本股。

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。

附件 环保行业划分标准

1.环保设备：防大气污染设备、消除噪声设备、监测仪器设备、废水处理、废弃物管理和循环利用设备等；

2.环保服务：控制大气污染、消除噪声、处理废弃物及处理废水等方面的活动，如：

- 脱硫、污水处理、垃圾发电等；

3.清洁生产技术和清洁产品：清洁生产技术与设备，新能源、清洁能源和可再生能源的开发及节能技术、设备，生态标志食品和绿色食品等，如：

- 新能源和清洁能源：乙醇汽油、太阳能、风力发电、水力发电、甲醇汽油等；
- 节能建材：节能型材、节能玻璃、保温材料等；
- 节能产品：节能灯等；
- 清洁产品：绿色农业、绿色食品、尾气净化剂等。