

## 深证战略性新兴产业指数系列编制方案

为反映深圳多层次市场战略性新兴产业上市公司的整体表现，向投资者提供战略性新兴产业上市公司指数化投资的标的，推进 ETF 等指数基金产品的开发，编制战略性新兴产业指数系列，包括深证战略性新兴产业指数、中小企业战略性新兴产业指数、创业板战略性新兴产业指数。

### 一、代码与名称

指数名称：深证战略性新兴产业指数

指数简称：深证新兴

英文名称：SZSE Strategic Emerging Industries Index

英文简称：SZSE Strategic Emerging Industries

指数代码：399641

指数名称：中小企业战略性新兴产业指数

指数简称：中小新兴

英文名称：SZSE SME Strategic Emerging Industries Index

英文简称：SME Strategic Emerging Industries

指数代码：399642

指数名称：创业板战略性新兴产业指数

指数简称：创业新兴

英文名称：SZSE ChiNext Strategic Emerging Industries Index

英文简称：ChiNext Strategic Emerging Industries

指数代码：399643

## 二、基日与基点

指数系列基日为 2010 年 6 月 30 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. 公司所处行业属于节能环保、新一代信息技术、生物、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车、数字创意产业、高技术服务业等战略性新兴产业及其细分领域之一。公司具有以下三个特征：产品有稳定并有发展前景的市场需求；良好的经济技术效益；能带动一批产业的兴起。

## 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，在深圳市场选取排名在前 200 名的股票，构成深证战略性新兴产业指数初始样本股；在原中小板市场选取排名在前 100 名的股票，构成中小企业战略性新兴产业指数初始样本股；在创业板市场选取排名在前 100 名的股票，构成创业板战略性新兴产业指数初始样本股。

## 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。