

中创高新技术企业指数编制方案

为反映深市原中小企业板及创业板高新技术企业上市公司的整体表现，提供更丰富的指数化投资标的，编制中创高新技术企业指数。

一、代码与名称

指数名称：中创高新技术企业指数

指数简称：中创高新

英文名称：SZSE SME-ChiNext High And New Technology
Enterprises Index

英文简称：SME- ChiNext HNTE

指数代码：399652

二、基日与基点

指数基日为 2011 年 6 月 30 日，基点为 1000 点。

三、选样空间

在深圳证券交易所原中小板和创业板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。

四、选样方法

首先，在满足入围标准的股票中剔除过去半年总市值排名后 10% 的股票或过去半年日均成交金额排名后 10% 的股票。

其次，参考国家颁布的《高新技术企业认定管理办法》，筛选出通过国家高新技术认定管理小组审核的企业的股票。

最后，将符合入选条件的股票按照过去三年研究开发费用占比（研究开发费用占营业收入的比率）的均值由高到低排名，选取排名前 50 的股票作为初始样本股。

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

每年实施一次样本股定期调整，于每年 6 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。

排名在样本数 70% 范围之内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数 130% 范围之内的原样本股按顺序优先保留。

在确定新入选成份股后，在剩余股票中按选样排名从高到低排序选取样本数量 5% 的股票作为备选样本股，用于指数样本股定期调整之间的临时调整。

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。