

深证节能环保指数编制方案

为了反映深市节能环保产业相关上市公司的整体表现，向投资者提供更丰富的指数化投资标的，推进指数基金产品的开发，编制深证节能环保指数。

一、代码与名称

指数名称：深证节能环保指数

指数简称：深证节能

英文名称：SZSE Energy Conservation Index

英文简称：SZSE Energy Conservation

指数代码：399695

二、基日与基点

指数基日为 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. 公司业务领域属于中国节能环保集团公司编制的节能环保产业分类及细分领域：

一级产业	二级产业
节能产业	工业节能
	建筑节能
	交通节能
	绿色建筑
环保产业	资源循环利用
	水处理
	空气治理
	土壤修复与重金属治理
	环境监测
清洁能源产业	风能
	太阳能
	生物燃料
	水电
	其他可再生能源
新材料	环保新材料
节能环保综合服务	监测评价与规划咨询
	环保资产交易商

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

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 名股票构成初始样本股，数量不足则按实际数量选入。

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：

实时指数 = 上一交易日收市指数

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

其中，样本股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、样本股权重调整”。

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。

七、样本股权重调整

在指数计算中，设置等权重因子以使单个样本股权重相等。

当指数样本股发生定期调整时，指数同步进行相应的权重因子调整，以调整实施日前倒数第 5 个交易日的收盘自由流通市值来计算调整时的权重调整因子。

当出现样本股临时调整时，新进样本股继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进股票的权重调整因子。