

深证科技指数编制方案

(2014年7月)

为了反映深圳证券交易所市场上科技型企业股票价格变动的趋势，并为市场增加一个新的指数投资品种，编制深证科技指数。深证科技指数包括纯价格指数和全收益指数，纯价格指数通过深交所行情系统发布实时行情数据，全收益指数通过巨潮指数网发布收盘行情数据。

一、 指数代码与名称

指数代码：399339

指数简称：深证科技

指数中文名称：深证科技指数

指数英文名称：SZSE TECH INDEX

二、 基日与基点

深证科技指数以2004年12月31日为基日，基日指数定为1000。

三、 选股原则

1. 入围标准

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) 在深圳证券交易所上市的非ST、*ST的A股；
- (2) 有一定上市交易日期，一般为六个月；
- (3) 非ST、*ST股票；
- (4) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；

(5) 考察期内股价无异常波动；

(6) 科技型上市公司业务领域具体涵盖的范围主要包括信息、生物、航空航天、新材料、先进能源及新能源汽车、现代农业、先进制造、节能环保及资源综合利用、海洋、高技术服务等。

2. 选样方法

在满足入围标准（1）-（6）中的入围条件后，参考科技部及工信部有关高科技企业的最新统计口径，确定样本股备选池。

样本股选样指标为一段时期（前 6 个月）平均总市值的比重、平均自由流通市值的比重和平均成交金额的比重。选样时先计算入围个股平均总市值占市场比重、平均自由流通市值占市场比重和平均成交金额占市场比重，再将上述指标按 1：1：1 的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序，选取排名在前 100 的股票，构成深证科技指数初始样本股。

四、 指数计算方法

同深证 100 指数。

五、 样本股调整

1. 样本股定期调整方法

同深证 100 指数。

2. 样本股临时调整方法

(1) 样本股暂停上市的，从暂停上市日起，将相应样本股从指数计算中剔除，并选择选样空间中排名最高的非样本股补足。

(2) 样本股终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，

将相应样本股从指数计算中剔除，并选择选样空间中排名最高的非样本股补足。

(3) 若样本股公司因重大违规行为（如财务报告重大造假）而可能被暂停或者终止交易的，将依据指数专家委员会的决定将其在指数样本中及时剔除，并选取选样空间中排名最高的非样本股作为样本股。

(4) 样本股公司发生收购、合并、分拆情形的处理，同深证 100 指数。

六、 指数的调整计算

同深证 100 指数。

七、 指数的发布与管理

同深证 100 指数。

八、 免责声明

同深证 100 指数。