

深证战略性新兴产业指数系列编制方案

(2014年1月)

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、中小板战略性新兴产业指数、创业板战略性新兴产业指数三条。

一、 指数代码与名称

指数代码：399641

指数简称：深证新兴

指数中文全称：深证战略性新兴产业指数

指数英文名称：SZSE STRATEGIC EMERGING INDUSTRIES
INDEX

指数代码：399642

指数简称：中小新兴

指数中文全称：中小板战略性新兴产业指数

指数英文名称：SZSE SME STRATEGIC EMERGING
INDUSTRIES INDEX

指数代码：399643

指数简称：创业新兴

指数中文全称：创业板战略性新兴产业指数

指数英文名称：SZSE CHINEXT STRATEGIC EMERGING
INDUSTRIES INDEX

二、 基日与基点

深证战略性新兴产业指数系列以 2010 年 6 月 30 日为基日，基日指数均为 1000 点。

三、 指数选股原则

1. 入围标准

- (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) 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。

2. 选样方法

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，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；在中小板市场选取排名在前 100 名的股票，构成中小板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。

四、 指数计算方法

同深证 100 指数。

五、 指数的调整计算

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。