

深证 200、深证 300、深证 700、深证 1000 指数编制方案

为了反映深圳市场不同规模特征股票的整体表现，向市场提供更丰富的分析工具和业绩基准，以深证 100 为基础，编制深证 200、深证 300、深证 700 和深证 1000 指数，共同构成深证规模指数体系。

一、代码与名称

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
深证 300 指数	深证 300	SZSE 300 Index	SZSE 300	399007
深证 200 指数	深证 200	SZSE 200 Index	SZSE 200	399009
深证 700 指数	深证 700	SZSE 700 Index	SZSE 700	399010
深证 1000 指数	深证 1000	SZSE 1000 Index	SZSE 1000	399011
深证 300 全收益指数	深证 300R	SZSE 300 Total Return Index	SZSE 300 TRI	399344

二、基日与基点

指数基日为 2004 年 12 月 31 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. 上市时间超过六个月，A 股总市值排名位于深圳市场前 1% 的股票除外；
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

1. 深证 300 指数、深证 1000 指数

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，选取前 300 名股票构成深证 300 指数样本股，选取前 1000 名股票构成深证 1000 指数样本股。

在排名相似的情况下，优先选取行业代表性强、盈利记录良好的上市公司股票作为样本股。

2. 深证 200 指数

深证 300 指数样本股剔除同期深证 100 指数样本股后剩下的 200 只股票构成深证 200 指数样本股。

3. 深证 700 指数

深证 1000 指数样本股剔除同期深证 300 指数样本股后剩下的 700 只股票构成深证 700 指数样本股。

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

深证 300、深证 1000 指数的样本股定期调整和临时调整方法同深证成指。

当深证 100、深证 300、深证 1000 指数调整样本股时，深证 200 和深证 700 指数随之进行相应的样本调整。