

# 深证民营指数编制方案

为了反映深圳证券市场上民营企业股票价格变动的趋势，并向投资者提供投资标的，编制深证民营指数。

## 一、代码与名称

指数名称：深证民营指数

指数简称：深证民营

英文名称：SZSE Non-SOE Index

英文简称：SZSE Non-SOE

指数代码：399337

## 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 的股票；
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；

民营企业定义：上市公司实际控制人为非国有独资、非国有控股及非外资控股。

#### 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。

#### 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

指数样本股实施半年度定期调整,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20%。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。