

国证深圳企业综合指数编制方案

为反映深圳本地上市公司证券价格变动趋势，编制国证深圳企业综合指数。

一、代码与名称

指数名称：国证深圳企业综合指数

指数简称：深企综指

英文名称：CNI Shenzhen Enterprises Composite Index

英文简称：Shenzhen Enterprises

指数代码：399352

二、基日与基点

指数的基日为 2004 年 8 月 31 日，基点为 864.38 点。

三、选样空间

满足下列条件的A股和红筹企业发行的存托凭证：

1. 非 ST、*ST 证券；
2. 公司注册地在深圳。

四、选样方法

选取选样空间内所有证券作为指数样本。

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：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则。

六、样本调整

对于涉及样本变动的事项实施实时调整，调整规则如下：

1. 科创板证券、北交所证券，于其上市 1 年后纳入指数计算；其他证券，于其上市后的第 11 个交易日纳入指数计算。
2. 被实施特别处理的样本，在实施特别处理日从指数中剔除。
3. 注册地在深圳被撤销特别处理的证券，在撤销特别处理日纳入指数计算。
4. 终止上市的样本，从进入退市整理期的第一个交易日起，从指数计算中剔除。

-
5. 注册地变更为深圳以外的地区的样本，在其变更公告的下一个交易日从指数中剔除。
 6. 注册地变更为深圳的证券，在其变更公告的下一个交易日纳入指数计算。