

深证行业指数编制方案

为反映深市不同行业公司证券的整体表现，将深市证券按国证行业分类标准分为 11 个行业，编制 11 只深市行业指数。

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
深证能源行业指数	深证能源	SZSE Energy Sector Index	SZSE Energy	399613
深证原材料行业指数	深证材料	SZSE Materials Sector Index	SZSE Materials	399614
深证工业行业指数	深证工业	SZSE Industrials Sector Index	SZSE Industrials	399615
深证可选消费行业指数	深证可选	SZSE Consumer Discretionary Sector Index	SZSE Consumer Discretionary	399616
深证主要消费行业指数	深证消费	SZSE Consumer Staples Sector Index	SZSE Consumer Staples	399617
深证医药卫生行业指数	深证医药	SZSE Health Care Sector Index	SZSE Health Care	399618
深证金融行业指数	深证金融	SZSE Financials Sector Index	SZSE Financials	399619
深证信息技术行业指数	深证信息	SZSE Information Technology Sector Index	SZSE Information Technology	399620
深证电信业务行业指数	深证电信	SZSE Telecommunication services Sector Index	SZSE Telecommunication services	399621
深证公用事业行业指数	深证公用	SZSE Utilities Sector Index	SZSE Utilities	399622
深证地产行业指数	深证地产	SZSE Real Estate Index	SZSE Real Estate	399637

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 证券；
2. 上市时间超过六个月；
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. 考察期内证券价格无异常波动。
6. 备选范围与国证行业分类标准对应关系如下表所示：

一级行业	二级行业（三级行业）
能源	能源(能源设备与服务；石油天然气；煤炭；可替代能源)
原材料	基础化工(化学原料；化学制品；农用化工；合成纤维)； 基础材料(建筑材料；容器与包装；黑色金属；有色金属； 非金属材料与制品；纸类与林业产品；合成金属)
工业	工业品(航天航空；建筑产品；电气部件与设备；重型 电气设备；通用机械；专用设备；工业集团企业)；工业 服务(建筑与工程；工业贸易经销商；商业用品与服务)； 运输(物流；航空运输；水上运输；陆运；交通基本设 施)
可选消费	汽车与汽车零配件(汽车零配件与设备；汽车)；耐用消 费品(家用电器；耐用家居用品；休闲设备与用品)；纺 织服装与奢侈品(服装与配饰；纺织品；珠宝与奢侈品)； 消费者服务(酒店餐饮与休闲；其他消费者服务)；传媒； 零售业(消费品经销商；网络零售；百货商店；专营零 售)
主要消费	食品与主要用品零售；农牧渔产品；食品饮料与烟草(食 品；饮料；烟草)；家庭与个人用品(家常用品；个人用 品)
医药卫生	医疗设备与服务(医疗设备与用品；医疗保健提供商与 服务)；制药(化学原料药；化学制剂；中药；药品流通)； 生物科技

金融	银行；综合金融（证券；保险；投资信托；其他金融服务；消费金融）；资本市场服务
信息技术	软件与互联网（互联网软件与服务；信息技术服务；计算机软件）；技术硬件与设备（电脑与外围设备；电子设备及服务；电子元器件；光电子器件）；半导体
电信业务	电信服务（电信运营；电信增值服务）；通信设备及技术服务（通信设备；通信技术服务）
公用事业	公用事业（电力公用事业；燃气公用事业；复合型公用事业；水公用事业）
房地产	房地产服务（房地产信托；房地产租赁；其他房地产服务）；房地产开发和管理（住宅地产开发和管理；商业地产开发和管理；工业地产开发和管理）

四、选样方法

首先，对样本空间证券按照最近半年的日均成交金额由高到低排名，剔除成交金额排名后 10% 的证券。

其次，在行业内按照总市值由高到低排序，依次选取排名靠前的进入指数，直至进入指数的证券累计市值行业占比达到 75%（行业总值按照样本空间证券分类计算）。

然后，若按照上述规则选取证券之后，指数样本数量尚不足 20 只的，剩余证券按照总市值降序依次入选直至补足 20 只或者样本空间全部证券入选。

五、指数计算

指数采用派氏加权法编制，采用下列公式逐日连锁实时计算：

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本权重调整”。

六、样本调整

1. 样本定期调整

指数样本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。样本调整方案通常在实施前两周公布。

2. 样本临时调整

样本出现终止上市时，将其从指数样本中剔除。

样本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。

七、样本权重调整

若样本数量在 10 只以下，不设权重限制；若样本数量在 10 只（含 10 只）以上，则对单个样本设 15% 的权重上限限制。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除证券在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进证券的权重调整因子。