

深证行业指数编制方案

为反映深市不同行业公司股票的整体表现，将深市个股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	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 股票；
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. 考察期内股价无异常波动。
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)
工业	工业品(航空航天；建筑产品；电气部件与设备；工业集团企业；专用设备)；工业服务；运输
可选消费	汽车与汽车零部件；耐用消费品与服装；纺织服务与奢侈品；消费者服务；媒体；零售业
主要消费	食品与主要用品零售；农牧渔产品；家庭与个人用品
医药卫生	医疗保健设备与服务；制药；生物科技
金融	银行；综合金融
信息技术	软件与服务；技术硬件与设备；半导体
电信业务	电信服务；通信设备及技术服务
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；房地产开发和管理
-----	----------------

四、选样方法

首先，对样本空间股票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% 的股票。

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，直至进入指数的股票累计市值行业占比达到 75%（行业总值按照样本空间股票分类计算）。

然后，若按照上述规则选取股票之后，指数样本股数量尚不足 20 只的，剩余股票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股票入选。

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

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

其中，样本股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、样本股权重调整”。

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。

2. 样本股临时调整

样本股出现暂停上市或终止上市时，将其从指数样本中剔除。

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。

七、样本股权重调整

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，于样本股定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本股临时调整时，新进样本股继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进股票的权重调整因子。