

深证行业龙头指数编制方案

为反映深市 A 股各行业龙头公司的整体表现，向投资者提供更丰富的指数化投资标的，编制深证行业龙头指数。

一、代码与名称

指数名称：深证行业龙头指数

指数简称：深证龙头

英文名称：SZSE Industry Top Index

英文简称：SZSE Industry Top

指数代码：399653

二、基日与基点

指数基日为 2010 年 6 月 30 日，指数基点为 1000 点。

三、选样空间

以深证 1000 指数样本为样本空间。

四、选样方法

依据国证行业分类标准，将沪深两市的证券划分至 30 个二级行业。使用过去两年平均营业收入、过去两年平均净利润、过去半年日均成交额和日均总市值四个指标对所有证券在二级行业内分别排名，然后将四项指标的排名结果加总计算总分，依据总分从低到高排序。从入围证券中选取排名前 50 的证券构成深证行业龙头指数的初始样本。若出现证券总分相同的情况，总市值大的证券优先入选。

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

1. 样本定期调整

指数样本实施半年定期调整，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。

每次样本调整数量不超过样本总数的 20%。

在确定新入选成份股后，在剩余证券中按综合排名从高到低排序选取样本数量 5% 的证券作为备选样本，用于指数样本定

期调整之间的临时调整。

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，选择备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

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。