

深证文化产业指数编制方案

为反映深市文化产业上市公司的整体表现，提供更丰富的指数化投资标的，编制深证文化产业指数。

一、代码与名称

指数名称：深证文化产业指数

指数简称：深证文化

英文名称：SZSE Culture Index

英文简称：SZSE Culture

指数代码：399654

二、基日与基点

指数基日为 2009 年 6 月 30 日，指数基点为 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 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；
6. 公司业务范畴属于以下定义文化产业及细分领域：

文化产业	细分领域
新闻服务	新闻
出版印刷发行	图书；杂志；报纸；信息
广播电视电影	广播；电视；电影
网络新媒体	门户网站；电子商务；搜索引擎；网络视频；网络游戏；互联网服务
动漫游戏	动漫、游戏
广告	媒体广告
会展节庆	会展、节庆
旅游	旅行社；景区及景区服务；主题公园；旅游演艺
文化用品	文具；玩具；音像器材
专用软件	数字视频；通讯集成
创意设计	园林设计；工业设计
其他服务	艺术品经营服务；版权服务；商务代理服务
体育	体育活动
教育	教育培训
非物质文化遗产	特色中药；特色餐饮

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 50 名股票构成初始样本股，数量不足则按实际数量选入。

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：

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 10%。排名在样本数 70% 范围之内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数 130% 范围之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。

七、样本股权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本股的权重不超过 5%。

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。