

深证农业综合企业指数编制方案

编制深证农业综合企业指数的目的是反映深圳证券交易所上市农业相关企业股票价格变动的趋势。

一、代码与名称

指数名称：深证农业综合企业指数

指数简称：深证农业

英文名称：SZSE Agriculture Index

英文简称：SZSE Agriculture

指数代码：399669

二、基日与基点

指数基日为 2004 年 12 月 31 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. 公司主营业务涉及农牧渔产品、食品饮料、农业化工、纸类与林业产品、农业与林业机械等行业，以及主营业务为农产品批发零售或生产农用生物化工产品。

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。

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%范围内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数130%范围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

在定期调整时，设置权重调整因子，使单只样本股在每次定期调整时的权重不超过10%。

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。