

指数修订公告

为增强指数可投资性，深圳证券交易所和深圳证券信息有限公司决定对存量指数进行修订。主要修订内容如下：

深证红利指数。一是选样空间修订为股息率水平高、分红连续性强、分红政策稳健且经营情况良好、流动性充分、流通市值规模较大的深市 A 股；二是选样方法修订为剔除预期净资产收益率处于后 50%且净资产收益率变化率处于后 20%的股票，选取累计分红金额和日均成交金额综合排名位于前 40 名的股票作为样本股；三是调整比例修订为不超过样本总数的 30%。

深证成长 40 指数。一是选样方法修订为剔除近半年日均成交金额或日均总市值排名处于后 30%以及扣非净利润小于 0 的股票，从剩余股票中选取成长特征突出、盈利超预期、行业代表性强且动量效应良好的 40 只股票作为样本股；二是调整频率修订为季度定期调整；三是调整比例修订为不超过样本总数的 30%；四是权重调整规则修订为采用因子倾斜方式计算初始权重且单只样本股权重不超过 10%。

本次修订将于 2024 年 12 月 16 日实施。修订后的编制方案见国证指数网（www.cnindex.com.cn）。

特此公告。

深圳证券交易所
深圳证券信息有限公司
2024年11月28日