

深证金贝塔系列策略指数发布

深圳证券信息有限公司与金贝塔网络金融科技有限公司日前宣布，为体现深市企业的价值与成长特色，向市场提供更丰富的 Smart Beta 策略指数投资标的，于 2017 年 9 月 15 日发布四条深证金贝塔系列策略指数，包括深证大盘红利指数、深证稳进价值指数、深证先锋成长指数、深证优势价值指数。

汇同前期发布的深证优势成长指数，该系列指数在深证市场已初步实现对大、中、小盘风格、以及价值、成长不同策略的覆盖。该系列指数均以 2008 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点，样本股数量均为 50 只。

深证大盘红利指数（指数代码：CN5138），旨在反映深圳市场大市值高红利企业的稳健盈利能力，精选经营稳健、盈利能力优秀且分红比例高的优秀企业为样本。样本股主要集中在深圳主板与中小板市场，分别为 18 只和 30 只，合计占比达到 96%。

深证稳进价值指数（指数代码：CN5139），旨在反映深圳市场具备安全边际企业的稳健盈利能力。样本股市场分布相对均匀，深证主板、中小板和创业板分别占比 26%、42% 和 32%。

深证先锋成长指数（指数代码：CN5140），旨在反映深圳市场优质小市值企业的成长特色，指数以市值小于 100 亿的企业为

样本空间，精选成长突出的优秀企业。样本股主要集中在中小板与创业板市场，合计占比达到 84%。

深证优势价值指数（指数代码：CN5141），旨在反映深圳市场中盘低估值企业的稳健盈利能力。样本股主要集中在深圳主板与中小板市场，分别为 32 只和 16 只，合计占比 96%。

上述指数均采用等权重方式加权计算，每年 2 月、5 月、8 月、11 月进行样本股及权重因子的定期调整。

据了解，自指数基日至 2017 年 9 月 5 日，四只指数分别实现了 409%、601%、2482% 及 505% 的累计收益，均远高于同期的市场基准指数，充分体现了 Smart Beta 策略的有效性。