

深证新浪大数据 100 指数发布

为了反映舆情大数据投资策略在证券市场的表现,丰富指数化投资标的,推动指数编制发展创新,2017年12月22日,深证新浪大数据 100 指数(以下简称新浪 100,代码:399297)在深圳证券交易所(以下简称深交所)上线发布。

新浪 100 指数由深圳证券信息有限公司(以下简称深证信息)与北京新浪互联信息服务有限公司(以下简称新浪网)共同开发,后续将与泛欧交易所(Euronext)合作在全球市场推广应用。该指数以 2013 年 12 月 31 日为基日,基点为 1000 点。数据显示,从基日至 2017 年 11 月 30 日,该指数累计收益率为 234%,超越同期市场基准,充分体现了采用舆情大数据策略分析的有效性。新浪 100 指数通过深耕互联网大数据信息和价值,构建因子模型,从新浪网的舆情数据中挖掘情绪指标作为选股因子,综合市场估值指标,筛选深市 100 只样本股编制指数。指数采用等权重方式加权计算,样本股及权重因子实施月度定期调整。

深证信息是深交所的全资子公司,国内证券信息服务领域的领先企业。深证信息致力于建设多层次资本市场的跨媒体信息传播体系,推出了巨潮资讯网、深交所互动易、深证/国证指数体系、股东大会网络投票系统、中国高新区科技金融信息服务平台等市场知名产品。作为国内最早开展指数业务的专业机构,深证信息具有丰富的指数研发和管理经验,打造了深证成份指数、深

证 100 指数、创业板指数等市场核心指数。通过与其他领域的优势机构合作，深证信息不断推动指数的编制创新，推出了央视 50 指数、大数据 100 指数等创新型指数，受到市场广泛关注和认可。新浪网在舆情数据中挖掘情绪指标方面，拥有强大的数据系统和及时准确的用户行为数据，同时也有丰富的经验。通过对财经大数据进行定性和定量分析，深证信息与南方基金及新浪网联合编制的南方新浪大数据系列指数运行良好。