

深证系列综合指数编制方案

(2013 年修订)

为了反映深圳证券交易所上市证券价格的综合变动情况以及市场总体走势，特编制深圳证券交易所深证系列综合指数。

一、涵盖范围

深证系列综合指数包含深证综合指数、深证 A 股指数、深证 B 股指数、行业分类指数、中小板综合指数、创业板综合指数、深市基金指数、深证新指数等全样本类指数。

二、选样标准

1. 深证综合指数：在深圳证券交易所主板、中小板、创业板上市的全部股票。
2. 深证 A 股指数：在深圳证券交易所主板、中小板、创业板上市的全部 A 股。
3. 深证 B 股指数：在深圳证券交易所上市的全部 B 股。
4. 行业分类指数：在深圳证券交易所主板、中小板、创业板上市的非 ST、*ST 的 A 股。行业分类指数依据《上市公司行业分类指引》中的门类划分，编制 19 条门类指数；依据制造业门类下的大类划分，编制 31 条大类指数，共有 50 条行业分类指数。对公司数量不足 5 家的门类和制造业大类，暂时不发指数，

指数代码预留，待公司数量满 5 只后发布。

5. 中小板综合指数：在深圳证券交易所中小企业板上市的全部股票。
6. 创业板综合指数：在深圳证券交易所创业板上市的全部股票。
7. 深市基金指数：在深圳证券交易所上市的全部封闭式基金（不包含创新型基金）。
8. 深证新指数：在深圳证券交易所主板、中小板、创业板上市的非 ST 且已完成股改的 A 股。

三、基日与基点

1. 深证综合指数以 1991 年 4 月 3 日为基日，1991 年 4 月 4 日开始发布，基日指数为 100。
2. 深证 A 股指数以 1991 年 4 月 3 日为基日，1992 年 10 月 4 日开始发布，基日指数为 100。
3. 深证 B 股指数以 1992 年 2 月 28 日为基日，1992 年 10 月 6 日开始发布，基日指数为 100。
4. 行业分类指数以 1991 年 4 月 3 日为基日，基日指数为 100，2001 年 7 月 2 日开始发布。
5. 中小板综合指数以 2005 年 6 月 7 日为基日，基日指数为 1000，2005 年 12 月 01 日开始发布。
6. 创业板综合指数以 2010-05-31 日为基日，基日指数为 1000，

2010 年 08 月 20 日开始发布。

7. 深市基金指数以 2000 年 6 月 30 日为基日,基日指数为 1000, 2000 年 7 月 3 日开始发布。
8. 深证新指数以 2005 年 12 月 30 日为基日,基日指数定为 1107.23, 2006 年 02 月 16 日开始发布。

四、计算方法

1. 深证系列综合指数均为派氏加权股价指数,即以指数样本股计算日股份数作为权数进行加权逐日连锁计算。
2. 深证综合指数、深证 A 股指数、深证 B 股指数均以样本股的发行总股本为权数进行加权,采用下列公式逐日连锁计算:

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股总股本})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股总股本})}$$

其中:样本股中的 B 股在计算指数时,价格按上周外汇调剂平均汇率折算成人民币

3. 深证行业分类综合指数以样本股的自由流通量为权数进行加权,采用下列公式逐日连锁计算:

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股自由流通量})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股自由流通量})}$$

4. 中小板综合指数、创业板综合指数、深证新指数采用可流通股本数加权,采用下列公式逐日连锁计算:

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股流通股本})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股流通股本})}$$

5. 基金指数以基金发行可流通份额为权数，采用下列公式逐日连锁计算：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{基金实时成交价} \times \text{基金流通份额})}{\sum (\text{基金上一交易日收市价} \times \text{基金流通份额})}$$

6. 深证系列综合指数均为实时计算，每个交易日集合竞价开市后用样本股的开市价计算开市指数，其后在交易时间内用样本股的实时成交价计算实时指数，收市后用样本股的收市价计算收市指数。
7. 样本股当日无成交的，取上一交易日收市价。样本股暂停交易的，取最近成交价。
8. 深证综合指数、深证 A 股指数、深证 B 股指数、中小板综合指数、创业板综合指数、深市基金指数、深证新指数计算所采用的权数，来源于深圳证券交易所每日发布的发行总股本与流通股本；深证行业分类综合指数计算所采用的权数，来源于深圳证券信息公司维护的自由流通量。

五、调整计算

深证系列综合指数的调整计算是根据不同情况，在开市前对指数实时计算公式中的有关数据项分别或同时进行调整：

1. 调整样本股的范围

即调整子项和母项中 \sum 的汇总范围，将某股票或基金纳入（剔除）

指数的计算，在实施当日，用新的样本股计算指数。

（1）新股上市

对于深证综合指数、深证 A 股指数、深证 B 股指数、行业分类指数、中小板综合指数、创业板综合指数及深证新指数，凡新股上市，在上市后第十一个交易日纳入指数计算。

（2）封闭式基金上市

对于深市基金指数，凡新基金上市，在上市次交易日纳入指数计算。

（3）恢复上市

凡有样本股恢复上市，在恢复上市次交易日纳入指数计算。

（4）实施或撤消特别处理

对深证新指数，凡有样本股被实施 ST 或*ST，在被实施特别处理日将该股票从指数中剔除，凡有股票撤消特别处理，在撤消特别处理日将该股票纳入指数计算。

（5）摘牌

凡有样本股或样本基金摘牌（终止交易），从其摘牌之日起，将其从指数计算中剔除。

（6）股权分置

对于深证综合指数、深证 A 股指数、中小板综合指数及深证新指数，凡有样本股实施股权分置，在股改方案实施后的第一个交易日或追送对价上市日不纳入指数计算，次交易日开始纳入指数计算。

（7）行业变更

已上市公司的行业类别发生变更时，依据中国证监会每季度末公布的上市公司行业分类结果，于下一个季度的首个交易日从其变动前行业对应的行业分类指数中剔除，纳入变动后行业对应的行业分类指数。

（8）停牌

样本股部分停牌时，指数照常计算。

2. 调整母项中某样本股的上一交易日收市价

当样本股进行派息、送股、配股、转增或其他除权情况，在除权除息日将母项中该样本股的股权登记日收市价更新为除权参考价。除权参考价以深圳证券交易所发布的数据为准。

3. 调整子项和母项中某样本股的权数

对深证综合指数、深证 A 股指数、深证 B 股指数、中小板综合指数、创业板综合指数、深市基金指数、深证新指数，凡有样本股发生股本变动（如增发、配股、送股、转增等引起总股本或可流通股本变化），样本股的权数在股本变动日进行实时修正，具体以深圳证券交易所发布的数据为准。

对深证行业分类综合指数，成份股公司进行送股、转增等权益分配及配股时，在除权日对成份股的自由流通量进行修正。成份股公司进行增发、配股时，在其新增股份上市日对成份股权数进行修正；成份股公司进行债转股、股份回购、权证行权时，在其公告日的下一个

交易日实施修正；成份股公司实施股权分置复牌时，根据支付对价后的自由流通量进行实时修正。对成份股公司出现股改限售上市、新股发行发起人限售期满、网下配售股解禁、定向增发大股东或战略投资者获配股份解禁、大股东增持、大股东减持等非公司行为引起的自由流通权数变化的，在每年的1月、7月的第一个交易日根据上市公司最新定期报告与临时公告中公布的持股数据进行定期集中修正。自由流通量以深圳证券信息公司维护的数据为准。

4. 汇率变动

每一交易周的最后一个交易日结束后，更新本周交易所港币与人民币的外汇调剂平均汇率。

六、发布与管理

1. 深证系列综合指数由深圳证券交易所授权并委托深圳证券信息有限公司编制、维护和运营。

2. 深证综合指数、深证A股指数、深证B股指数、中小板综合指数、创业板综合指数、深市基金指数、深证新指数以及行业分类指数中的19条门类指数通过深圳证券交易所通信系统对外发布，行业分类指数中的31条制造业大类指数在深圳证券信息公司线下指数运算系统计算并通过巨潮指数网发布收盘行情数据。

3. 指数样本信息通过深圳证券交易所网站(www.szse.cn)、巨潮指数网站(index.cninfo.com.cn)发布。

4. 深证系列综合指数属于深圳证券交易所资产，未经深圳证券交易所书面许可，任何单位或个人不得跟踪、交易深证系列综合指数，或以深证系列综合指数作为评价基准。

七、免责声明

本文件和其中的所有信息，包括但不限于所有的文字、数据、图表、表格属于深圳证券信息有限公司的财产，受中国知识产权法律及相关法律保护。未经深圳证券信息有限公司书面许可，不得将这些信息全部或部分复制或再次传播。

本文件及其中任何信息均不构成任何证券、金融产品或其他投资工具或任何交易策略的依据或建议，也不表示深圳证券交易所、深圳证券信息有限公司及其关联方关于任何发行人、证券、金融产品或工具或交易策略的意见。

对任何直接或间接使用本文件及其任何信息而造成的损失，包括但不限于因内容不准确、不完整而导致的损失，深圳证券交易所、深圳证券信息公司及其关联方无须承担任何法律责任。