

深市精选指数编制方案

(2014年5月)

为了反映深市具有一定规模和影响力上市公司的股价变动走势，引导上市公司提升信息披露与规范运作水平，提供可交易的指数产品和金融衍生工具的标的物，编制深市精选指数。

一、 指数代码与名称

指数代码：399013

指数简称：深市精选

指数中文名称：深市精选指数

指数英文名称：SZSE SELECT INDEX

二、 基日与基点

深市精选指数以 2004 年 12 月 31 日为基日，基日指数为 1000。

三、 选股原则

深市精选指数样本股由在深圳证券交易所主板和中小板上市的 A 股组成，按照下列入选标准并结合上市公司的市场代表性、经营状况选取样本：

1. 非 ST、*ST 的 A 股；
2. 最近一期信息披露考核等级为 A 或者 B；
3. 最近 12 个月日均市值为 50 亿元以上；
4. 最近 12 个月日均股价为 5 元以上；

5. 最近一年营业收入大于 10 亿元或者净利润大于 1 亿元。

四、 指数计算方法

深市精选指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

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

样本股：指纳入指数计算范围的股票。

样本股权数：为样本股的自由流通量，子项和母项的权数相同。

分子与分母：分子项中的乘积为样本股实时自由流通市值，分母项中的乘积为样本股上一交易日收市自由流通市值。

Σ：是指对纳入指数计算的样本股自由流通市值进行汇总。

自由流通量：是上市公司实际可供交易的流通股数量，它是无限售条件股份剔除“持股比例超过 5%的下列三类股东及其一致行动人所持有的无限售条件股份”后的流通股数量：①国有（法人）股东；② 战略投资者；③ 公司创建者、家族或公司高管人员。

自由流通市值：股票价格乘以自由流通量。

股票价格选取：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。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。

五、 样本股调整

1. 样本股定期调整方法

样本股定期调整定于每年 7 月的第一个交易日实施，通常在实施

前的两周内公布调整方案。

2. 样本股临时调整方法

(1) 新上市股票，若首发总市值不低于 50 亿，发行价格不低于 5 元，且信息披露考核等级、最近一年营业收入与净利润指标符合入选标准，则在上市后第十一个交易日纳入指数计算。

(2) 样本股公司发生收购合并的，包括样本股公司合并、样本股公司合并非样本股公司、非样本股公司合并样本股公司等，均考察合并后的新公司股票。若符合纳入标准，合并后的新公司股票保留样本股资格。

(3) 样本股公司分拆为两家或多家公司，分别考察分拆后形成的公司股票，符合纳入标准的作为新样本进入指数。

(4) 样本股暂停上市的，从暂停上市日起，将相应样本股从指数计算中剔除。

(5) 样本股终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，将相应样本股从指数计算中剔除。

(6) 若样本股公司因重大违规行为（如财务报告重大造假）而可能被暂停或者终止交易的，将依据指数专家委员会的决定将其在指数样本中及时剔除。

六、 指数的调整计算

1. 调整母项中某样本股的上一交易日收市价

深市精选指数分为全收益指数和价格指数。

对于全收益指数，当上市公司进行派息、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。

对于价格指数，现金分红在除息日不作除权调整，其余处理方法同全收益指数。

2. 调整子项和母项中某样本股的权数即 A 股自由流通量

(1) 样本股公司进行送股、转增等权益分配及配股时，在除权日对样本股的自由流通量进行修正；样本股公司进行增发、配股时，在其新增股份上市日对样本股的自由流通量进行修正；样本股公司进行债转股、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；样本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。

(2) 对样本股公司因股改限售上市、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量变化，在每年 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股东持股数据进行集中修正。

七、 指数的发布与管理

1. 深市精选指数的发布

深市精选指数通过深交所实时卫星广播系统向全国发布，并通过汤森路透（Thomson Reuters）和彭博（Bloomberg）等信息商向全球发布。收市指数在每个交易日收市后通过中国证监会指定信息披露报刊和其他新闻媒体对外发布。

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

2. 深市精选指数的管理

深市精选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、维护和管理。深圳证券信息有限公司指数事业部定期对样本股的代表性进行考察，根据考察结果审议是否更换样本股。

深市精选指数属于深圳证券交易所资产，未经深交所或深圳证券信息公司书面许可，任何单位或个人不得跟踪、交易该指数，或以该指数为评价基准。

八、 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。