

# 深证成份 B 股指数编制方案

( 2019 年 2 月 )

为了反映深圳证券 B 股市场的运行情况，提供业绩基准和投资目标的，编制深证成份 B 股指数。

## 一、 代码与名称

指数代码：399003

指数简称：成份 B 指

指数中文名称：深证成份 B 股指数

指数英文名称：SHENZHEN COMPONENT B RETURN INDEX

## 二、 基日与基点

指数基日为 1994 年 7 月 20 日，基点为 1000 点。

## 三、 选样空间

在深圳证券交易所上市交易且满足下列条件的所有 B 股：

1. 非 ST、\*ST 股票；
2. 上市时间超过六个月，总市值排名位于深圳市场前 10 名的

股票除外；

3. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
4. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
5. 考察期内股价无异常波动。

#### 四、 选样方法

首先，计算入围选样空间股票在最近半年的 B 股日均总市值和 B 股日均成交金额；

其次，对入围股票在最近半年的 B 股日均成交金额按从高到低排序，剔除排名后 10% 的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年的 B 股日均总市值从高到低排序，选取前 10 名股票构成指数样本股。

在排名相似的情况下，优先选取行业代表性强、盈利记录良好的上市公司股票作为样本股。

#### 五、 指数计算

深证成份 B 股指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

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

**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。

$\Sigma$ ：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**：价格按上一交易周最后一个交易日国家外汇管理局公布的港币兑人民币中间价折算成人民币。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。

## 六、 样本股调整

同深证成份指数。

## 七、 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

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。

## 2. 调整子项和母项中某样本股的权数即自由流通量

同深证成份指数。

## 3. 汇率变动

港币兑人民币汇率于每一交易周最后一个交易日收市后更新，数据取自国家外汇管理局当日公布的人民币汇率中间价。

## 八、 指数的发布与管理

同深证成份指数。

## 九、 免责声明

同深证成份指数。