

深证 300 指数编制方案

(2019 年 2 月)

为了提供可交易的指数产品和金融衍生工具的标的物，满足证券市场进一步发展的需要，编制深证 300 指数。

一、 代码与名称

指数代码：399007

指数简称：深证 300

指数中文名称：深证 300 指数 (价格)

指数英文名称：SZSE 300 PRICE INDEX

指数代码：399344

指数简称：深证 300R

指数中文名称：深证 300 指数 (收益)

指数英文名称：SZSE 300 RETURN INDEX

二、 基日与基点

指数基日为 2004 年 12 月 31 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 A 股：

1. 非 ST、*ST 股票；
2. 上市时间超过六个月，A 股总市值排名位于深圳市场前 1% 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 A 股日均总市值和 A 股日均成交金额；

其次，对入围股票在最近半年的 A 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 A 股日均总市值从高到低排序，选取前 300 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

同深证成份指数。

六、 样本股调整

同深证成份指数。

七、 指数的调整计算

同深证成份指数。

八、 指数的发布和管理

同深证成份指数。

九、 免责声明

同深证成份指数。