

# 深证央企指数编制方案

( 2019 年 2 月 )

为反映深圳证券交易所中央企业控股上市公司股票价格变动的趋势，并向投资者提供投资标的，编制深证央企指数。深证央企指数包括纯价格指数和全收益指数，纯价格指数通过深交所行情系统发布实时行情数据，全收益指数通过国证指数网发布收盘行情数据。

## 一、 代码与名称

指数代码：399335

指数简称：深证央企

指数中文名称：深证央企指数

指数英文名称：SZSE CENTRAL SOE 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. 有一定上市交易日期，一般为六个月；
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；
6. 中央企业定义：上市公司实际控制人为国务院国资委或财政部控股。

#### 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，选取排名在前 50 的股票，构成深证央企指数初始样本股。

#### 五、 指数计算

同深证成份指数。

#### 六、 样本股调整

##### 1. 样本股定期调整

同深证成份指数。

## 2. 样本股临时调整

(1) 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，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(2) 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，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(3) 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，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(4) 样本股被交易所实施风险警示（ST 或\*ST）的，从实施风险警示次月的第二个星期五的下一个交易日起将其从指数样本中剔除，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(5) 样本股公司发生收购、合并、分拆情形的处理，同深证成份指数。

## 七、 指数的调整计算

同深证成份指数。

## 八、 指数的发布与管理

同深证成份指数。

## 九、 免责声明

同深证成份指数。