

深证治理指数编制方案

(2019 年 2 月)

为了反映深圳市场上公司治理结构有效 ,经营业绩良好的上市公司股票运行态势 ,编制深证治理指数。深证治理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 : 399328

指数简称 : 深证治理

指数中文名称 : 深证治理指数

指数英文名称 : SZSE CORP GOVERNANCE INDEX

二、 基日与基点

指数基日为 2002 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. 考察期内股票价格无异常波动；
6. 在国证公司治理综合评级中，绩效评分超过 6 分。

四、 选样方法

将备选股票按照最近一年主营业务收入占市场比重、净利润占市场比重和国证公司治理评分（1：1：20）综合排名，选取排名在前 40 的构成深证治理指数初始样本股。

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

每年调整一次，于每年 6 月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。调整原则同深证成份指数。

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、 维护和发布。

同深证成份指数。

九、 免责声明

同深证成份指数。