

## 指数介绍

深证优势成长指数反映了深市低估值且成长潜力良好的股票运行特征。指数通过分析股票基本面数据，同时结合市场交易数据，建立多因子模型，精选出成长性高且估值合理的 50 只深交所上市公司股票组成样本股，旨在向市场提供更丰富的量化策略指数标的，满足指数产品创新发展的需要。

## 指数构建

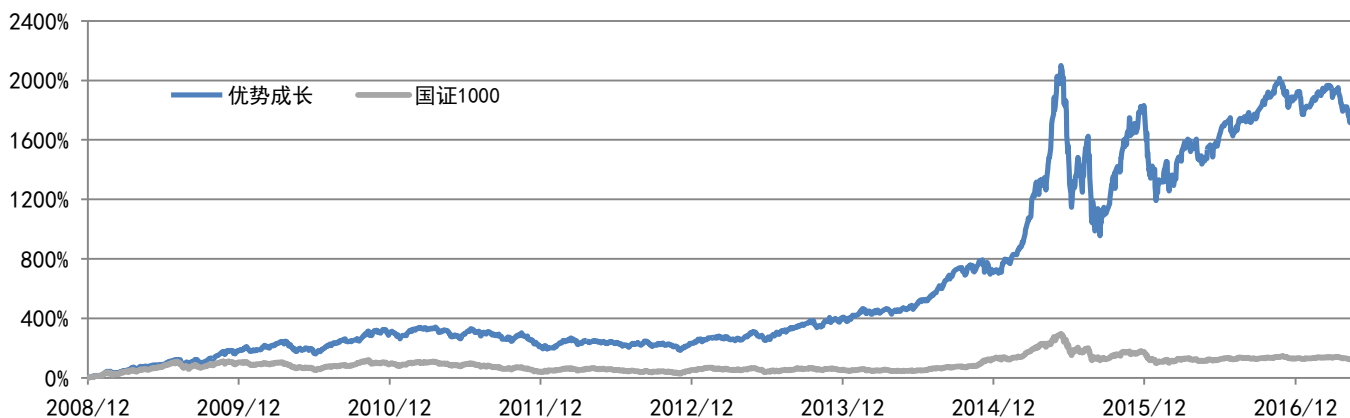
### 选样范围

在深交所上市交易的 A 股，满足一定的上市交易日期，公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题、经营无异常和重大亏损，考察期内股价无异常波动。

### 选样指标

在入围个股中以净资产收益率等财务指标作为成长性因子，选出成长性综合表现排名靠前的前 1/2 的股票；然后在入围的成长性股票中，综合考虑估值、流动性等指标，选出估值合理的前 50 只股票构成指数样本股。

## 指数历史走势 (2008 年 12 月 31 日-2017 年 5 月 31 日)



国证 1000 用以反映 A 股市场整体走势

## 收益与波动 (日收益) (2017 年 5 月 31 日)

指数	阶段收益				年化收益		年化标准差		夏普比率	
	1 个月	3 个月	1 年	今年以来	3 年	5 年	3 年	5 年	3 年	5 年
优势成长	-6.26%	-10.36%	10.32%	-9.44%	47.32%	39.21%	36.15%	31.61%	7.94%	7.62%
国证 1000	-1.34%	-3.20%	3.56%	0.03%	15.78%	7.22%	28.61%	25.62%	4.01%	2.33%

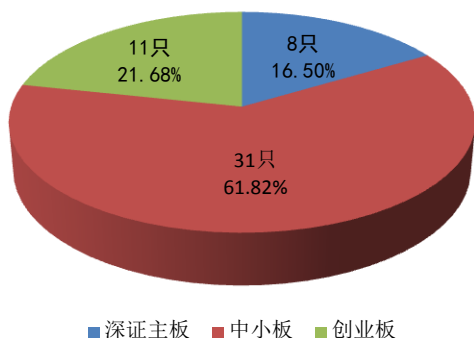
## 分年度收益

指数	2016	2015	2014	2013	2012	2011
优势成长	-10.21%	86.23%	38.87%	43.08%	0.27%	-33.19%
国证 1000	-15.46%	18.41%	47.25%	1.41%	7.40%	-26.84%

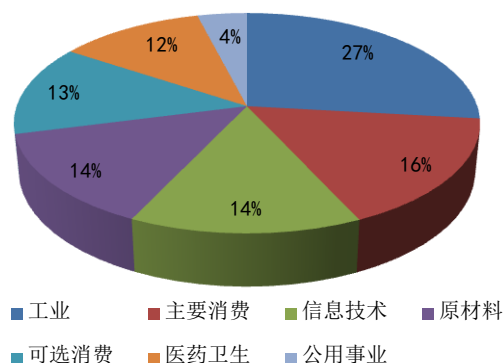
## 统计数据 (2017 年 5 月 31 日)

权重 (%)		自由流通市值 (权重调整后, 亿元)				
最大样本	最小样本	合计	最大	最小	均值	中位数
2.51	1.70	361.36	9.06	6.15	7.23	7.23

板块分布 (公司数量和权重占比) (2017年5月31日)



行业分布 (权重占比) (2017年5月31日)



十大权重股 (2017年5月31日)

样本	代码	权重	行业
启明信息	002232	2.51	信息技术
北大医药	000788	2.31	医药卫生
新宁物流	300013	2.25	工业
金新农	002548	2.22	主要消费
粤高速 A	000429	2.18	工业
奥克股份	300082	2.16	原材料
荣盛石化	002493	2.13	原材料
长江润发	002435	2.13	工业
天桥起重	002523	2.12	工业
吉宏股份	002803	2.11	工业
总计		15.88%	

指数资料

样本股数量	50
加权方式	等权重
基点/基期	1000点/2008年12月31日
定期调整样本股	每季度定期调整一次, 于1月、4月、7月和10月的第一个交易日正式实施, 在实施前的两周内公布调整方案
计算频率	在深交所交易时段每3秒钟计算一次
发布日	2017年6月15日

代码

指数全称	指数简称	指数英文名称	深交所/国证代码	Wind
深证优势成长指数 (价格)	优势成长	SZSE GB Growth Index	399698	399698.SZ
深证优势成长指数 (全收益)	优势成长 R	SZSE G-Beta Growth Return Index	CN2698	CN2698.CNI

深证系列指数是深圳证券交易所的资产, 深圳证券交易所委托深圳证券信息有限公司负责深证系列指数的研发、运维和营销。未经深圳证券交易所和深圳证券信息有限公司的授权许可, 任何机构和个人不得擅自使用深证系列指数用作任何商业用途, 包括但不限于用作投资组合的业绩比较基准或者产品的标的指数。以上数据均来源于深圳证券信息有限公司, 仅作为信息参考, 深圳证券信息有限公司力求数据的正确, 但不保证数据的错误以及由于使用此公开材料所造成的商业损失承担任何责任。

指数历史表现并不作为未来收益的保证。

如欲知更详细的指数信息, 请访问 [www.cnindex.com.cn](http://www.cnindex.com.cn); 电邮 [index.services@cninfo.com.cn](mailto:index.services@cninfo.com.cn); 或致电 +86-755 8324 1251