

# 上证国有企业 100 指数编制方案

上证国有企业 100 指数选取沪市规模较大、盈利能力较强的 100 家国有企业上市公司证券作为指数样本，以反映沪市代表性国有企业上市公司证券的整体表现。

## 一、指数名称和代码

指数名称：上证国有企业 100 指数

指数简称：上证国企

英文名称：SSE State-owned Enterprises 100 Index

英文简称：SSE State-owned 100

指数代码：000056

## 二、指数基日和基点

该指数以 2009 年 6 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

## 三、样本选取方法

### 1、样本空间

同上证 180 指数的样本空间

### 2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 80%。

### 3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取属于中央企业或

地方国有企业的上市公司证券作为待选样本；

(2) 将上述待选样本按照净资产收益率和过去一年日均总市值由高到低排名，然后将两项指标的排名结果相加作为证券的综合排名，选取综合排名靠前的100只证券作为指数样本。

#### 四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 =  $\Sigma(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于0和1之间，以使单个样本权重不超过10%，单个中证二级行业权重不超过20%。

#### 五、指数样本和权重调整

##### 1、定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

##### 2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。