

上证超级大盘指数编制方案

上证超级大盘指数从沪市大盘中选取过去一年日均总市值和日均成交金额排名前 20 名的上市公司证券作为指数样本，以反映最具代表性的 20 只大盘上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证超级大盘指数

指数简称：超大盘

英文名称：SSE Mega-cap Index

英文简称：SSE Mega-cap

指数代码：000043

二、指数基日和基点

该指数以 2003 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证 180 指数样本

2、选样方法

(1) 计算样本空间内证券过去一年日均成交金额与日均总市值；

(2) 对样本空间内证券过去一年日均成交金额和日均总市值由高到低排名，然后将两指标的排名结果相加，所得和的排名作为证券的综合排名，原则上选取排名在前 20 名的证券作为指数样本；按照行业分类方法，单一一级行业证券在

指数中的样本数量不超过 6 只。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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 5%。

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。每次调整的样本比例一般不超过 10%。定期调整设置缓冲区，排名在 16 名之前的新样本优先进入；排名在 24 名之前的老样本优先保留。

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。