

上证大中小盘系列指数编制方案

上证大中小盘系列指数按照市值和成交量水平将沪市上市公司证券分为中盘、小盘、中小盘、大中小盘，以反映不同规模上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
上证中盘指数	上证中盘	SSE MidCap Index	SSE MidCap	000044
上证小盘指数	上证小盘	SSE SmallCap Index	SSE SmallCap	000045
上证中小盘指数	上证中小	SSE Mid&SmallCap Index	SSE Mid&SmallCap	000046
上证大中小盘指数	上证全指	SSE Large&Mid&SmallCap Index	SSE Large&Mid&SmallCap	000047

二、指数基日和基点

该指数系列以 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

同上证 180 指数的样本空间

2、选样方法

(1) 上证中盘指数选样方法

上证中盘指数样本由上证 180 指数样本中非上证 50 指数样本的 130 家上市公司证券构成。

(2) 上证小盘指数选样方法

从样本空间中扣除上证 180 指数样本后，剩余待选样本根据过去一年的日均

总市值和日均成交金额进行综合排名，取排名前 320 位的上市公司证券作为指数样本。

(3) 上证中小盘指数和上证大中小盘指数选样方法

上证中盘指数和上证小盘指数样本一起构成上证中小盘指数样本；上证 180 指数和上证小盘指数样本一起构成上证大中小盘指数样本。

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 = \sum (证券价格 × 调整股本数)。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。

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%，上证 50、上证 180、上证小盘指数样本的调整自动体现在上证中盘、上证中小盘和上证全指中。

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。