

上证地方国有企业 50 指数和国有企业 100 指数编制方案

上证地方国有企业 50 指数选取上海证券市场规模大、流动性好、具有代表性的 50 家地方国有企业上市公司证券作为指数样本；上证国有企业 100 指数样本由上证地方国有企业 50 指数样本和上证中央企业 50 指数样本组合而成。二者全面刻画沪市大型国有企业上市公司证券的整体表现，并为相关指数化投资产品的开发提供基础工具。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文全称	英文简称	指数代码
上证地方国有企业 50 指数	上证地企	SSE Local State-owned Enterprises 50 Index	SSE Local State-owned 50	000055
上证国有企业 100 指数	上证国企	SSE State-owned Enterprises 100 Index	SSE State-owned 100	000056

二、指数基日和基点

该指数系列以 2009 年 6 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

（一）、上证地方国有企业 50 指数

1、样本空间

上证 180 指数的样本空间中实际控制人为地方国资委、地方人民政府、地方国有企业的上市公司证券。

2、选样方法

对样本空间内上市公司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，所得和的排名作为上市公司证券的综合排名，原则上选取排名在前 50 名证券作为指数样本。

（二）、上证国有企业 100 指数

指数样本由上证地方国有企业 50 指数样本和上证中央企业 50 指数样本组合而成。

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，以使上证地企指数和上证国企指数中单个样本权重分别不超过 15% 和 10%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

上证地方国有企业 50 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 40 名之前的新样本优先进入；排名在 60 名之前的老样本优先保留。

上证国有企业 100 指数样本随上证地方国有企业 50 指数和上证中央企业 50 指数样本的定期调整而随之进行调整。

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。当上证地方国有企业 50 指数和上证中央企业 50 指数样本发生临时调整时,上证国有企业 100 指数样本随之调整。