

## 中证上海国企指数编制方案

中证上海国企指数以上海市（含区县）国有企业上市公司证券为待选样本，结合市值、国资持股比例、分红比率、市场预期等情况进行选择并加权，以反映上海国企上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证上海国企指数

指数简称：上海国企

英文名称：CSI Shanghai SOEs Index

英文简称：Shanghai SOEs Index

指数代码：950096

上交所转播代码：000865

### 二、指数基日和基点

该指数以 2012 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）对样本空间内证券，选取所有上海市（含区县）国资控制或能施加重大影响上市公司证券作为待选样本；

(2) 对于上述待选样本，基于总市值、国资持股比例、分红比率、市场预期计算待选样本对应的综合得分，按照综合得分由高到低排名；选取排名靠前的不超过 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 =  $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使样本采用综合得分加权，单个样本权重不超过 8%。

#### 五、指数样本和权重调整

##### 1、定期调整

指数样本每季度调整一次，样本调整实施时间分别为每年 3 月、6 月、9 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。