

上证消费 80 指数编制方案

上证消费 80 指数选取沪市中规模大、流动性好的 80 只主要消费、可选消费和医药卫生行业上市公司证券作为指数样本，以反映沪市中消费类上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证消费 80 指数

指数简称：消费 80

英文名称：SSE Consumer 80 Index

英文简称：SSE Consumer 80

指数代码：000069

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

上证全指指数样本

2、选样方法

(1) 将样本空间中行业分类为可选消费、主要消费和医药卫生的上市公司证券列为消费类证券；

(2) 将样本空间中消费类上市公司证券按照过去一年日均总市值与日均成交金额由高到低排名，所得和的排名作为证券的综合排名，选取综合排名前 80

的证券作为指数样本。

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 = Σ (证券价格 × 调整股本数 × 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%。

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。