

上证 380 指数编制方案

上证 380 指数以上证 180 指数样本空间剔除部分证券后的沪市证券为样本空间，从中根据证券营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名，并按照中证二级行业的自由流通市值比例分配样本只数，在二级行业内选取综合排名最靠前的 380 只证券作为样本。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 380 指数

指数简称：上证 380

英文名称：SSE 380 Index

英文简称：SSE 380

指数代码：000009

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 指数的样本空间中剔除下列证券后的沪市证券组成：

- (1) 上证 180 指数样本；
- (2) 最新一期财务报告中未分配利润为负的公司；
- (3) 成立五年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司。

2、选样方法

(1) 计算样本空间内证券营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名；

(2) 按照中证二级行业的自由流通调整市值比例分配样本只数。具体计算方法如下：

第 i 行业样本配额=第 i 行业所有候选证券自由流通调整市值之和/样本空间所有候选证券自由流通调整市值之和×380；

(3)按照行业的样本分配只数，在二级行业内选取综合排名最靠前的证券。

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=∑(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%。

2、临时调整

在两次定期调整之间，若上证380指数样本进入上证180指数，该样本立即被调出上证380指数，并由该调出样本同行业排名最靠前的样本补足。

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。