

上证金融地产行业指数编制方案

上证金融地产行业指数选取沪市样本中属于金融和房地产行业的上市公司证券作为指数样本，以反映沪市样本中金融和房地产上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证金融地产行业指数

指数简称：上证金融

英文名称：SSE Financials Sector Index

英文简称：SSE Financials

指数代码：000038

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

同上证 180 指数的样本空间

2、选样方法

（1）在样本空间内，选取中证行业分类为金融和房地产行业的全部证券作为待选样本；

（2）对待选样本按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 15% 的证券，并剔除累计市值占比达到 98% 以后的证券；

(3) 如果待选样本数量在 30 只（含）以内，将全部证券纳入指数；

(4) 如果待选样本数量超过 30 只，将待选样本在行业内按照总市值排序，依次选取排名靠前的进入指数，直至进入指数的样本累计市值占比达到 80%或数量达到 50 只，若进入指数的样本数量少于 30 只，则按照总市值排名增加至 30 只。

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 × 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 15%。

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样本进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。当样本公司有特殊事件发生，导致其行业归属发生变更时，将对指数进行相应调整。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。