

上证行业分层等权重指数系列编制方案

上证行业分层等权重指数系列分别选取属于能源、原材料、工业、可选消费、主要消费、医药卫生、金融、房地产、信息技术、通信服务以及公用事业十一个一级行业的上市公司证券作为指数样本，并通过权重设置，使二级行业间实现市值加权，二级行业内个股实现等权，为投资者提供多样化的投资标的。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
上证能源行业分层等权重指数	能源等权	SSE Energy Sector Equal Weight index	SSE Energy EW	000070
上证原材料行业分层等权重指数	材料等权	SSE Materials Sector Equal Weight index	SSE Materials EW	000071
上证工业行业分层等权重指数	工业等权	SSE Industrials Sector Equal Weight index	SSE Industrials EW	000072
上证可选消费行业分层等权重指数	可选等权	SSE Consumer Discretionary Sector Equal Weight index	SSE Cons Disc EW	000073
上证主要消费行业分层等权重指数	消费等权	SSE Consumer Staples Sector Equal Weight index	SSE Cons Staples EW	000074
上证医药卫生行业分层等权重指数	医药等权	SSE Health Care Sector Equal Weight index	SSE Health Care EW	000075
上证金融行业分层等权重指数	金融等权	SSE Financials Sector Equal Weight index	SSE Financials EW	000076
上证房地产行业分层等权重指数	房地产等权	SSE Real Estate Sector Equal Weight index	SSE Real Estate EW	950218
上证信息技术行业分层等权重指数	信息等权	SSE Information Technology Sector Equal Weight index	SSE Info Tech EW	000077
上证通信服务行业分层等权重指数	通信等权	SSE Communication Services Sector Equal Weight index	SSE Communication Services EW	000078
上证公用事业行业分层等权重指数	公用等权	SSE Utilities Sector Equal Weight index	SSE Utilities EW	000079

二、指数基日和基点

该指数系列除上证房地产行业分层等权重指数以 2007 年 12 月 28 日为基日外，其余指数均以 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) 对样本空间内证券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；

(2) 对剩余上市公司证券数量在 30 只（含）以内的行业，将全部证券纳入相应行业指数；

(3) 对剩余上市公司证券数量超过 30 只的行业，将剩余证券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 与 1 之间，以使指数内二级行业权重与市值权重相同，二级行业内所有样本权重相同。

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。