

## 上证行业指数系列编制方案

上证行业指数系列将沪市的全部样本按照行业分类标准划分为能源、原材料、工业等一级行业，并选择各个行业对应的上市公司证券编制相应的行业指数，以反映上证行业指数在二级市场的整体表现。

### 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
上证能源行业指数	上证能源	SSE Energy Sector Index	SSE Energy	000032
上证原材料行业指数	上证材料	SSE Materials Sector Index	SSE Materials	000033
上证工业行业指数	上证工业	SSE Industrials Sector Index	SSE Industrials	000034
上证可选消费行业指数	上证可选	SSE Consumer Discretionary Sector Index	SSE Cons Disc	000035
上证主要消费行业指数	上证消费	SSE Consumer Staples Sector Index	SSE Cons Staples	000036
上证医药卫生行业指数	上证医药	SSE Health Care Sector Index	SSE Health Care	000037
上证房地产行业指数	上证地产	SSE Real Estate Sector Index	SSE Real Estate	950217
上证信息技术行业指数	上证信息	SSE Information Technology Sector Index	SSE Info Technology	000039
上证通信服务行业指数	上证通信	SSE Communication Services Sector Index	SSE Communication Services	000040
上证公用事业行业指数	上证公用	SSE Utilities Sector Index	SSE Utilities	000041

### 二、指数基日和基点

该指数系列除上证房地产行业指数以 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，基点为 1000 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 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。