

## 上证 380 行业指数系列编制方案

上证 380 行业指数系列将上证 380 指数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证券作为相应的行业指数样本，以反映上证 380 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	英文全称	英文简称	指数代码
上证 380 能源指数	380 能源	SSE 380 Energy Index	380 Energy	000104
上证 380 原材料指数	380 材料	SSE 380 Materials Index	380 Materials	000105
上证 380 工业指数	380 工业	SSE 380 Industrials Index	380 Industrials	000106
上证 380 可选消费指数	380 可选	SSE 380 Consumer Discretionary Index	380 Cons Discretionary	000107
上证 380 主要消费指数	380 消费	SSE 380 Consumer Staples Index	380 Cons Staples	000108
上证 380 医药卫生指数	380 医药	SSE 380 Health Care Index	380 Health Care	000109
上证 380 金融指数	380 金融	SSE 380 Financials Index	380 Financials	000110
上证 380 房地产指数	380 地产	SSE 380 Real Estate Index	380 Real Estate	950216
上证 380 信息技术指数	380 信息	SSE 380 Information Technology Index	380 Information	000111
上证 380 通信服务指数	380 通信	SSE 380 Communication Services Index	380 Communication	000112
上证 380 公用事业指数	380 公用	SSE 380 Utilities Index	380 Utilities	000113

### 二、指数基日和基点

该指数系列除上证 380 房地产指数以 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

上证 380 指数样本

#### 2、选样方法

(1) 借鉴国际主流行业分类标准，并结合我国上市公司特点进行调整，将上市公司分为能源、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、公用事业共 11 个行业；

(2) 将样本空间内的证券按行业分类标准进行分类，进入各自行业的全部证券作为相应行业指数的样本。

### 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 =  $\sum$ (证券价格  $\times$  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。

## 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。

当上证 380 指数调整样本时,上证 380 行业指数系列样本随之进行相应调整。当样本公司有特殊事件发生,导致其行业归属发生变更时,将对上证 380 行业指数系列样本进行相应调整。