

上证 50 指数编制方案

上证 50 指数以上证 180 指数样本为样本空间，挑选上海证券市场规模大、流动性好的最具代表性的 50 只证券作为样本，综合反映上海证券市场最具市场影响力的一批龙头企业的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 50 指数

指数简称：上证 50

英文名称：SSE 50 Index

英文简称：SSE 50

指数代码：000016

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 指数样本

2、选样方法

对样本空间内的证券按照过去一年的日均总市值、日均成交金额进行综合排名，选取排名前 50 位的证券组成样本。

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 = Σ (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%，定期调整设置缓冲区，排名在 40 名之前的新样本优先进入，排名在 60 名之前的老样本优先保留。

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。对新发行证券的发行总市值（总市值=发行价×总股本）和沪市证券自该新发行证券上市公告日起过去一年的日均总市值进行比较，对于符合样本空间条件、且发行总市值排名在沪市市场前 10 位的新发行证券，启用快速进入指数规则，即在其上市第十个交易日结束后将其纳入指数，同时剔除原样本中过去一年日均总市值、成交金额综合排名最末的证券，科创板上市证券不适用该规则。