

上证 180 指数编制方案

上证 180 指数是在原上证 30 指数编制方案的基础上作进一步完善后形成的，以沪市证券为样本空间，选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、股票价格无明显异常波动或市场操纵的公司，并按照中证一级行业的自由流通市值比例分配样本只数，在行业内选取综合排名最靠前的 180 只证券作为样本，旨在建立一个反映上海证券市场的概貌和运行状况、能够作为投资评价尺度及金融衍生产品基础的基准指数。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 180 指数

指数简称：上证 180

英文名称：SSE 180 Index

英文简称：SSE 180

指数代码：000010

二、指数基日和基点

该指数以 2002 年 6 月 28 日为基日，以 3299.06 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

指数样本空间由同时满足以下条件的非 ST、*ST 沪市 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：

(1) 科创板证券：上市时间超过一年。

(2) 其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 18 位。

2、选样方法

按照以下四个步骤选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、股票价格无明显异常波动或市场操纵的公司：

(1) 根据总市值和成交金额对证券进行综合排名。具体方法是：根据过去一年的日均数据，对各指标分别排名，然后将各指标的排名结果相加，所得和的排名作为证券的综合排名；

(2) 按照行业的自由流通调整市值比例分配样本只数。具体计算方法如下：

第 i 行业样本配额 = 第 i 行业所有候选证券自由流通调整市值之和 / 样本空间所有候选证券自由流通调整市值之和 × 180；

(3) 按照行业的样本分配只数，在行业内选取综合排名最靠前的证券；

(4) 对各行业选取的样本作进一步调整，使样本总数为 180 只。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 3299.06$$

其中，调整市值 = \sum (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%。

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。