

上证综合全收益指数编制方案

上证综合全收益指数是上证综合指数的衍生指数，由在上海证券交易所上市的符合条件的股票与存托凭证组成样本，并将样本分红计入指数收益，反映上海证券交易所上市公司在计入分红收益后的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证综合全收益指数

指数简称：上证指数全收益

英文名称：SSE Composite Total Return Index

英文简称：SSE TRI

指数代码：000001CNY01

二、指数基日和基点

该指数以 2020 年 7 月 21 日为基日，以 3320.89 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证综合全收益指数的样本空间由在上海证券交易所上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成。ST、*ST 证券除外。

2、选样方法

上证综合全收益指数选取所有样本空间内证券作为指数样本。

四、指数计算

上证综合全收益指数的计算公式为：

$$T \text{ 日全收益指数点位} = T - 1 \text{ 日全收益指数收盘点位} \times \frac{\sum (\text{样本} T \text{ 日收盘价} \times \text{样本} T \text{ 日总股本} \times \text{汇率})}{\sum (\text{样本} T \text{ 日开盘参考价} \times \text{样本} T \text{ 日总股本} \times \text{汇率})}$$

其中，T 日代表任意交易日，T-1 日代表 T 日的上一交易日。开盘参考价是指根据公司事件（如现金分红）调整的当日开盘参考价格。汇率同上证综合指数，具体参见指数计算与维护细则。

五、指数样本调整

上市以来日均总市值排名在沪市前 10 位的证券于上市满三个月后计入指数，其他证券于上市满一年后计入指数。样本被实施风险警示的，从被实施风险警示措施次月的第二个星期五的下一交易日起将其从指数样本中剔除；被撤销风险警示措施的证券，从被撤销风险警示措施次月的第二个星期五的下一交易日起将其计入指数。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、停牌等情形的处理，参照指数计算与维护细则处理。