

上证 G60 战略新兴产业成份指数编制方案

上证 G60 战略新兴产业成份指数在长三角 G60 九城市的沪市上市公司中，选取不超过 50 家规模最大的战略新兴产业上市公司证券作为指数样本，反映相关地区的战略新兴产业上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 G60 战略新兴产业成份指数

指数简称：G60 成指

英文名称：SSE G60 Component Index

英文简称：G60 Component Index

指数代码：950049

二、指数基日和基点

该指数以 2016 年 5 月 24 日为基日，以 1000 点为基点。

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 20% 的证券；

(2) 选取所有注册地位于长三角 G60 九城市（上海松江、嘉兴、杭州、金华、苏州、湖州、宣城、芜湖、合肥）且属于中国战略新兴产业综合指数样本的上市公司证券作为待选样本；

(3) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值从高到低排序，选取排名最前的 50 只证券作为指数样本；当待选样本不足 50 只时，全部纳入指数。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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%，前五大样本权重不超过 60%。

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。