

上证新型基础设施建设主题指数编制方案

上证新型基础设施建设主题指数从上海市场中选取 100 只业务涉及 5G 基础设施、人工智能、大数据中心、工业互联网、特高压、城际高铁和轨道交通、新能源汽车充电桩等新型基础设施建设的上市公司证券作为指数样本，以反映上海市场新基建领域上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证新型基础设施建设主题指数

指数简称：沪新基建

英文名称：SSE New Infrastructure Thematic Index

英文简称：SSE New Infrastructure

指数代码：950189

二、指数基日和基点

该指数以2014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

上证新型基础设施建设主题指数的样本空间由满足以下条件的股票和存托凭证构成：

（1）上市时间超过三个月，除非该股票的日均总市值排在沪市前 18 位；

（2）非 ST、*ST 股票。

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) 在剩余样本中，选取业务涉及新型基础设施建设领域的上市公司证券作为待选样本，包括但不限于以下领域：

- 为 5G 基础设施建设提供器件材料、设备网络等设备或服务；
- 为人工智能技术发展提供芯片、机器视觉、语音语义识别等设备或服务；
- 为大数据中心建设提供建设施工及服务器、存储等设备或服务；
- 为工业互联网建设提供传感器、数控系统、互联网平台等设备或服务；
- 为特高压建设提供变压器、电抗器、绝缘器件、电线电缆等设备或服务；
- 为城际高铁和轨道交通建设提供整车及配件、建筑等设备或服务；
- 为新能源汽车基础设施建设提供充电桩、网络运营等设备或服务；
- 为城镇化建设提供卫生、教育、体育、环保等城市基础设施配套；

(3) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 100 的证券作为指数样本，且每个业务领域的样本数量不超过 20 只。

四、指数计算

上证新型基础设施建设主题指数的计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本股的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

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 5%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

上证新型基础设施建设主题指数的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。