

上证 G60 创新综合指数编制方案

上证 G60 创新综合指数选取所有位于长三角 G60 九城市的沪市上市公司股票作为样本股,反映相关地区上市公司的整体表现,为投资者提供新的投资标的。

一、指数名称和代码

指数名称: 上证 G60 创新综合指数

指数简称: G60 综指

英文名称: SSE G60 Composite Index

英文简称: G60 Composite Index

指数代码: 950048

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

上证 G60 创新综合指数的样本空间由满足以下条件的沪市 A 股构成:

(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,非暂停上市股票。

2、选样方法

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)的上市公司股票作为样本股。

四、指数计算

上证 G60 创新综合指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数})$ 。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

上证 G60 创新综合指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整，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。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。