

关于发布上证中盘和上证小盘等指数的公告

为反映上海证券市场不同规模特征股票的整体表现,上海证券交易所和中证指数有限公司将于2009年7月3日正式发布上证中盘指数、上证小盘指数、上证中小盘指数和上证全指四条指数。上证中盘指数代码000044,上证小盘指数代码为000045,上证中小盘指数代码为000046,上证全指指数代码为000047。上述四条指数的基日均为2003年12月31日,基点均为1000点。

有关上述指数的编制方法与详细资料可参见上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)和中证指数有限公司网站(www.csindex.com.cn)。

上海证券交易所

中证指数有限公司

二〇〇九年六月十七日

附：上证中盘、上证小盘等指数编制方案

一、指数名称和代码

上证中盘指数（简称上证中盘），代码为：000044

上证小盘指数（简称上证小盘），代码为：000045

上证中小盘指数（简称上证中小），代码为：000046

上证全指（简称上证全指），代码为：000047

二、基日和基点

上证中盘指数、上证小盘指数、上证中小盘指数和上证全指以2003年12月31日为基日，基点为1000点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证规模指数样本空间由剔除下列股票后的所有上海A股股票组成：

- 上市时间不足一个季度的股票，除非该股票的日均总市值排在沪市的前18位；
- 暂停上市股票；
- 经营状况异常或最近财务报告严重亏损的股票；
- 股价波动较大、市场表现明显受到操纵的股票；
- 其他经专家委员会认定的应该剔除的股票。

2、选样方法

(1) 上证中盘指数选样方法

上证中盘指数成份股由上证 180 成份股中非上证 50 的 130 家成份股公司构成。

(2) 上证小盘指数选样方法

对样本空间内剩余的股票(扣除上证 180 指数成份股后的样本空间),根据总市值、成交金额对股票进行综合排名,取排名前 320 位的股票组成样本,但市场表现异常并经专家委员会认定不宜作为样本的股票除外;

(3) 上证中小盘指数和上证全指选样方法

上证中盘指数和上证小盘指数成份股一起构成上证中小盘指数成份股;

上证 180 和上证小盘指数成份股一起构成上证全指成份股。

四、指数计算与修正

上证中盘、上证小盘、上证中小盘和上证全指采用派许加权综合价格指数公式进行计算,计算公式如下:

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期成份股的调整市值}}{\text{基期}} \times 1000$$

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

五、样本股调整

上证指数专家委员会一般在每年的 6 月及 12 月的中上旬开会审

核上证规模指数，样本股调整实施时间分别是每年7月、1月份的第一个交易日。定期调整指数样本时，上证小盘指数每次调整比例一般不超过10%。上证50、上证180、上证小盘指数成份股的调整自动体现在上证中盘、上证中小盘和上证全指中。