

# 上证 100 指数编制方案

# 一、指数名称与代码

指数名称:上证 100 指数

指数简称:上证 100

指数英文名称: SSE 100 Index

指数英文简称: SSE 100

指数代码: 000132

#### 二、指数基日与基点

上证 100 指数的基日为 2003 年 12 月 31 日,基点为 1000 点。

# 三、样本选取方法

1、样本空间

上证 100 指数的样本空间为上证 380 指数样本股。

### 2、选样方法

将样本空间中的股票按照营业收入增长率、净资产收益率分别由高到低排名,将两个指标的排名结果相加,所得和的排名作为股票的综合排名,选取综合排名前 100 名的股票作为指数样本。

#### 四、指数计算

上证 **100** 指数采用派许加权方法,按照样本股的调整股本数为权数加权计算,计算公式如下:

报告期指数=报告期样本股的调整市值/基期×1000,

其中,调整市值= $\Sigma$ (股价×调整股本数),调整股本数的计算方法同上证全指。

#### 五、指数修正

同上证 180 指数。

#### 六、样本股调整

上证 100 指数原则上每半年调整一次样本股,样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五收盘后的下一交易日,每次调整的样本股数量不超过 10%。样本股定期调整时设置缓冲区,排名在 80 名内的新样本优先进入,排名在 120 名内的老样本优先保留。在两次定期调整之间,当上证 380 指数发生样本股临时调整时,将视情况对上证 100 指数样本做出相应调整。