

## 上证沪股通指数编制方案

### 一、 指数名称及代码

中文名称	英文名称	中文简称	英文简称	指数代码
上证沪股通指数	SSE SH Equities Index	沪股通	SH Equities	000159

### 二、 指数基日与基点

上证沪股通指数以 2003 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

以沪市全部 A 股（非 ST ， \*ST 股）为样本空间，

#### 2、 选样方法

选取样本空间内上证 180 指数样本、上证 380 指数样本及 A+H 股上市公司的上海证券交易所上市 A 股（不包括被实施风险警示的股票）等符合沪股通范围的股票作为上证沪股通指数样本。

### 四、 指数计算

上证沪股通指数采用派许加权方法，按照样本股的调整股本数为权数进行加权计算，计算公式为：

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

其中：调整市值 =  $\Sigma$ (股价  $\times$  调整股本数)，调整股本数的计算方法同上证 180 指数。指数的修正同上证 180 指数。

## 五、 定期调整

上证沪股通指数每半年定期调整一次，定期调整于每年六月以及十二月第二个周五收盘后生效。

## 六、 临时调整

当沪股通范围发生变化时，上证沪股通指数样本股进行相应调整。