

# 上证一带一路主题指数编制方案

## 一、 指数名称及代码

- 指数名称：上证一带一路主题指数
- 指数简称：沪新丝路
- 英文名称：SSE One Belt & One Road Index
- 英文简称：SSE OBOR
- 指数代码：000160
- 全收益指数：H00160

## 二、 指数基日与基点

该指数以 2012 年 12 月 31 日为基日，以该日收盘后所有样本股的调整市值为基期，以 1000 点为基点。

## 三、 样本选取方法

### 1、 样本空间

由全部沪市 A 股组成，上市时间不足三个月，未完成股权分置改革，ST 公司、\*ST 公司及暂停上市的 A 股除外。

### 2、 选样方法

第一步，将样本空间内过去一年日均成交金额排名在后 10% 的股票剔除。

第二步，将一带一路主题划分为五大相关产业，分别为：基础建设、交通运输、高端装备、电力通信、资源开发。每个产业根据下表对应不同的细分行业。

五大产业	中证四级行业
基础建设	建筑与工程
	建筑材料

交通运输	海港与服务
	公路与铁路
	海运
	铁路
高端装备	工业机械
	建筑、农用机械与重型卡车
	电子设备制造商
电力通信	电气部件与设备
	重型电气设备
	通信设备
资源开发	综合性石油与天然气企业
	石油与天然气设备与服务
	石油与天然气的勘探与生产
	多种金属与采矿

第三步，在每个产业中，在综合考虑过去一年日均总市值、现有海外业务占比、新签一带一路地区订单、主营业务所在地域等四个维度的基础上，选取最具主题代表性的股票入选，并确保每个产业入选的股票总数不超过 15 个。

第四步，将五大产业入选的所有股票作为指数样本股。

#### 四、 指数计算

指数计算公式为：

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

其中，调整市值 =  $\Sigma$ (股价 × 调整股本数 × 权重上限因子)，调整股本数的计算方法同上证 180 指数；权重上限因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本股权重不超过 5%。

#### 五、 指数修正

同上证 180 指数。

#### 六、 样本股调整

上证一带一路主题指数每季度定期审核一次样本股，并根据审核结果调整指数样本股，样本股调整实施时间为每年 3 月、6 月、9 月和 12 月的第二个星期

五收盘后的下一交易日。定期调整指数样本时，设置 20%的调整比例限制。当成份股公司有特殊情况发生时（如收购、合并、分拆、退市等），对指数进行临时调整。

## 七、 权重上限因子调整

权重上限因子每季度随样本股定期调整而调整一次，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同，采用样本股定期调整生效日前第五个交易日的收盘后数据计算。

当出现样本临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，新进入指数的股票继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的权重，并据此重新计算新进股票的权重上限因子；当有指数样本股被剔除，但没有其他股票进入指数时，不再重新计算权重上限因子。当样本股股本结构发生显著变化或其他原因导致权重发生突变时，将决定是否对权重上限因子进行临时调整。