

上证380指数编制方案

一、指数名称与代码

指数名称：上证380指数

指数简称：上证380

指数英文名称：SSE 380 Index

英文简称：SSE 380

指数代码：000009

二、指数基日与基点

上证380指数以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380指数的样本空间由上证180指数样本空间剔除下列股票后的所有沪市A股组成：

- 上证180指数样本股
- 最新一期财务报告中未分配利润为负的公司
- 成立5年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司

2、选样方法

步骤1：计算样本空间股票营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名。

步骤2：按照二级行业的自由流通市值比例分配样本只数。具体方法是：

第*i*行业样本配额=第*i*行业所有候选股票自由流通市值之和/样本空间所有候选股票自由流通市值之和×380。

步骤3：按照行业的样本分配只数，在二级行业内选取综合排名最靠前的股票；

四、指数计算

上证380指数采用派许加权综合价格指数公式进行计算，计算公式如下：

$$\text{报告期指数} = \text{报告期样本股总调整市值} / \text{基期} \times 1000$$

其中，总调整市值 = \sum (股价×调整股本数)，调整股本数的计算方法同上证180指数。

五、指数修正

同上证180指数。

六、样本股调整

上证380指数每半年调整一次样本股，样本股调整实施时间分别为每年6月和12月的第二个星期五收盘后的下一交易日。

在两次定期调整之间，若上证380指数样本股进入上证180指数，该样本立即被调出上证380指数，并由该调出样本同行业排名最靠前的样本补足。