

上证公司治理指数编制方案

上证公司治理指数选取上证公司治理板块的上市公司证券作为指数样本，旨在鼓励和促进上市公司进一步改善公司治理，提升上市公司的整体质量。

一、指数名称和代码

指数名称：上证公司治理指数

指数简称：治理指数

英文名称：SSE Corporate Governance Index

英文简称：Governance Index

指数代码：000019

二、指数基日和基点

该指数以 2007 年 6 月 29 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

指数样本空间由上证公司治理板块的上市公司 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成。

2、选样方法

选取样本空间内所有上市公司证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每半年调整一次。上证公司治理板块于每年 5 月和 11 月进行评选，中证指数有限公司根据评选结果对指数样本进行调整。样本调整实施时间为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当上证公司治理板块公司发生严重负面事件的，将尽快从上证公司治理板块中予以剔除，该指数同时进行相应调整。