

上证流通指数编制方案

上证流通指数由在上海证券交易所上市的符合条件的股票与存托凭证组成样本，采用自由流通股本加权，反映上海市场自由流通股份的股价变化。

一、指数名称和代码

指数名称：上证流通指数

指数简称：上证流通

英文名称：SSE Free Float Index

英文简称：SSE Free Float

指数代码：000090

二、指数基日和基点

上证流通指数以 2009 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

上证流通指数的样本空间由在上海证券交易所上市的 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成。未完成股权分置改革、ST、*ST 证券除外。

2、选样方法

上证流通指数选取所有样本空间内证券作为指数样本。

四、指数计算

上证流通指数的计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 15%。权重因子于每月第二个星期五的下一交易日或新计入样本权重超过 15% 时调整。在下一个调整日前，权重因子一般固定不变。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见指数计算与维护细则。

五、指数样本调整

上市以来日均总市值排名在沪市前 10 位的证券于上市满三个月后计入指数，其他证券于上市满一年后计入指数。样本被实施风险警示的，从公告将被实施风险警示措施次月的第二个星期五的下一交易日起将其从指数样本中剔除；被撤销风险警示的证券，从被撤销风险警示措施次月的第二个星期五的下一交易日起将其计入指数。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、停牌等情形的处理，参照指数计算与维护细则处理。