

上证 180 指数编制方案

上证 180 指数从沪市证券中选取市值规模较大、流动性较好的 180 只证券作为样本，反映上海证券市场核心上市公司证券整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 180 指数

指数简称：上证 180

英文名称：SSE 180 Index

英文简称：SSE 180

指数代码：000010

二、指数基日和基点

该指数以 2002 年 6 月 28 日为基日，以 3299.06 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

指数样本空间由同时满足以下条件的非 ST、*ST 沪市 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：

(1) 科创板证券：上市时间超过一年；

(2) 其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 18 位。

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，剔除中证 ESG 评价结果在 C 及以下的上市公司证券，将剩余证券作为待选样本；

(2) 在待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 180 的证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 3299.06$$

其中，调整市值 = Σ (证券价格 × 调整股本数 × 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%，前五大样本权重合计不超过 40%，且一级行业权重合计占比与样本空间相应一级行业自由流通市值合计占比保持一致。

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，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。每次调整的样本比例一般不超过 10%。

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。