

上证 580 指数编制方案

上证 580 指数从沪市证券中选取市值规模较小、流动性较好的 580 只证券作为样本，反映上海证券市场市值较小上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证 580 指数

指数简称：上证 580

英文名称：SSE 580 Index

英文简称：SSE 580

指数代码：950580

二、指数基日和基点

该指数以 2018 年 12 月 28 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

同上证 180 指数的样本空间

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；

(2) 从上述剩余证券中，选取同时满足以下条件的证券作为待选样本；

- 非上证 180、上证 380 指数样本；
- 过去一年日均总市值位于样本空间 500 名以后；

(3) 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 580 的证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

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

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%，前五大样本合计权重不超过 40%。

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。每次调整的样本数量比例一般不超过 20%。

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。