

上证指数相关计算公式证券从业资格考试 PDF转换可能丢失
图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/646/2021_2022__E4_B8_8A_E8_AF_81_E6_8C_87_E6_c33_646269.htm 上证指数系列均采用派许加权综合价格指数公式计算 上证180指数 上证成份指数以成份股的调整股本数为权数进行加权计算，计算公式为：
报告期指数 = 报告期成份股的调整市值 / 基日成份股的调整市值 × 1000 其中，调整市值 = (市价 × 调整股本数)，基日成份股的调整市值亦称为除数，调整股本数采用分级靠档的方法对成份股股本进行调整。根据国际惯例和专家委员会意见，上证成份指数的分级靠档方法如下表所示。比如，某股票流通股比例(流通股本/总股本)为7%，低于10%，则采用流通股本为权数；某股票流通比例为35%，落在区间(30，40)内，对应的加权比例为40%，则将总股本的40%作为权数。

流通比例(%)	10	(10, 20]	(20, 30]	(30, 40]	(40, 50]	(50, 60]	(60, 70]	(70, 80]	gt.80
加权比例(%)	20	30	40	50	60	70	80	100	

上证红利指数 上证红利指数采用派许加权方法，按照样本股的调整股本数为权数进行加权计算。计算公式为：报告期指数 = 报告期成份股的调整市值 / 基期 × 基期指数 其中，调整市值 = (市价 × 调整股数)。调整股本数采用分级靠档的方法对成份股股本进行调整。上证红利指数的分级靠档方法如下表所示：

流通比例(%)	10	(10, 20]	(20, 30]	(30, 40]	(40, 50]	(50, 60]	(60, 70]	(70, 80]	>.80
加权比例(%)	20	30	40	50	60	70	80	100	

综合指数与分类指数 上证综合指数与分类指数以样本股的发行股本数为权数进行加权计算，计算公式为：报告期指数 = 报告期成份股的总市值 / 基

期 \times 基期指数 其中，总市值 = (市价 \times 发行股数)。新上证综指 新上证综指采用派许加权方法，以样本股的发行股本数为权数进行加权计算，计算公式为：报告期指数 = (报告期成份股的总市值 / 基期) \times 基期指数 其中，总市值 = (市价 \times 发行股数)。基金指数 基金指数以基金发行份额为权数进行加权计算，计算公式为：报告期指数 = 报告期基金的总市值 / 基期 \times 基日指数 其中，总市值 = (市价 \times 发行份额)。B股价格单位 成份股中的B股在计算上证B股指数时，价格采用美元计算。成份股中的B股在计算其他指数时，价格按适用汇率(中国外汇交易中心每周最后一个交易日的人民币兑美元的中间价)折算成人民币。百考试题编辑整理 100Test 下载频道 开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com