

# 关于发布上证企债 30 和上证海外上市 A 股等指数的公告

为进一步丰富上证指数体系,推进产品创新,上海证券交易所和中证指数有限公司将于2010年1月第一个交易日正式发布上证企债30指数、上证海外上市A股指数、上证地方国有企业50指数、上证国有企业100指数、上证全指成长指数、上证全指价值指数、上证全指相对成长指数、上证全指相对价值指数和上证沪深企指数等九条指数。指数编制方案详见上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)和中证指数有限公司网站(www.csindex.com.cn)。

上海证券交易所  
中证指数有限公司  
2009年12月17日

## 附件一: 上证海外上市 A 股指数编制方案

上证海外上市 A 股指数从上海证券交易所上市的证券中挑选同时在上海证券交易所以及大陆以外交易所上市的上市证券组成样本,以反映上海证券市场上含有海外上市股份的证券的整体走势,同时为投资者提供新的分析工具和投资标的。

一、指数代码、名称  
指数代码:000054  
指数名称:上证海外上市 A 股指数  
指数简称:上证海外  
指数英文名称:SSE Overseas-listing A shares index  
指数英文简称:SSE Overseas-listing  
二、指数基期与基点  
上证海外上市 A 股指数以 2006 年 12 月 29 日为基日,以该日所有样本的调整市值为基期,基点为 1000 点。

三、样本选取办法  
1. 样本空间  
指数样本空间由同时满足以下条件的证券组成:  
■在上海证券交易所上市交易,同时在其他大陆地区以外的交易所上市交易;  
■上证 180 指数样本股

2. 选择方法  
选取所有样本空间内证券组成指数样本。  
四、指数计算  
采用派许加权综合价格指数公式进行计算,公式如下:

$$报告期指数 = \frac{报告期样本总市值调整市值}{基期} \times 1000$$

其中,调整市值 = ∑(股价×调整股本数×权重上限因子),调整股本数同该股票在上证 180 指数中的调整股本数。权重上限因子介于 0 和 1 之间,以使样本股权重不超过 15%。

五、指数修正  
需要修正的情况,参照上证 180 指数。  
六、样本调整  
上证海外上市 A 股指数样本随上证 180 指数样本变化,发生相应变化。

七、权重上限因子调整  
权重上限因子每年随样本股定期调整而调整两次,调整时间为每年 1 月和 7 月的第一个交易日,以调整前最后一个交易日收盘的调整市值来计算调整时的权重上限因子。当出现样本股临时调整时,以调整前最后一个交易日收盘的调整市值来计算调整时的权重上限因子;当样本股本结构出现显著变化或者其它原因导致其权重发生突变时,将决定是否对权重上限因子进行临时调整。

## 附件二: 上证地方国有企业 50 指数和 上证国有企业 100 指数编制方案

一、指数名称和代码  
上证地方国有企业 50 指数简称上证地企,英文名称为 SSE Local State-owned Enterprises 50 Index,英文简称为 SSE Local State-owned 50,指数代码为 000055。

上证国有企业 100 指数简称上证国企,英文名称为 SSE State-owned Enterprises 100 Index,英文简称为 SSE State-owned 100,指数代码为 000056。

二、基日和基点  
上证地方国有企业 50 指数和上证国有企业 100 指数基日为 2009 年 6 月 30 日,基点为 1000 点。

三、样本选取方法  
上证地方国有企业 50 指数:  
1、样本空间  
上证地方国有企业 50 指数的样本空间由同时满足以下条件的沪市 A 股股票组成:

□在上海证券交易所上市的实际控制人为地方国资委、地方人民政府、地方国有企业的上市公司股票;  
□上市时间超过三个月,除非该股票自上市以来的日均总市值排在沪市前 18 位;  
□非 ST、\*ST 股票,非暂停上市股票;  
□经营状况良好,最近一年无重大违法违规事件,财务报告无重大问题;  
□股价无明显的异常波动或市场操纵。

2、选择方法  
第一,计算样本空间内股票最近一年(新股为上市以来)的 A

股日均成交额与日均总市值;

第二,对样本空间内股票在最近一年的 A 股日均成交额和日均总市值由高到低排名,然后将两指标的排名结果相加,所得和的排名作为股票的综合排名,原则上选取排名在前 50 名的股票作为指数样本。

上证国有企业 100 指数:  
上证国有企业 100 指数样本由上证地方国有企业 50 指数和上证中央企业 50 指数样本组成。

四、指数计算与修正  
上证地方国有企业 50 指数和上证国有企业 100 指数采用派许加权方法,按照样本股的调整股本数为权重进行加权计算,计算公式为:

$$报告期指数 = \frac{报告期样本总市值调整市值}{基期} \times 1000$$

其中:调整市值 = ∑(股价×调整股本数×权重上限因子),调整股本数的计算方法同上证 180 指数。权重上限因子介于 0 和 1 之间,以使单个样本股权重分别不超过 15%和 10%。指数的修正同上证 180 指数。

五、定期调整  
上证地方国有企业 50 指数依据稳定性和动态跟踪相结合的原则,每年定期审核两次样本股,并根据审核结果调整指数样本股。除非原非样本股同上市公司实际控制人变更导致的调整比例超过 10%,原则上每次调整比例不超过 10%。样本股调整实施时间为每年 1 月份和 7 月份的第一个交易日。样本股定期调整时设置缓冲区,排名在 40 名内的新样本优先进入,排名在 60 名之前的老样本优先保留。

上证国有企业 100 指数样本随上证地方国有企业 50 指数和上证中央企业 50 指数样本的定期调整而随之进行调整。

六、临时调整  
当上市公司股权关系发生变动导致其控股属性发生变化或者指数成份股出现吸收合并等事件时,将对上证地方国有企业 50 指数样本进行临时调整,两次定期调整之间,上证地方国有企业 50 指数的样本数量可多于或少于 50 只。

当上证地方国有企业 50 指数和上证中央企业 50 指数样本发生临时调整时,上证国有企业 100 指数样本随之调整。

七、权重上限因子调整  
权重上限因子每年随样本股定期调整而调整两次,调整时间为每年 1 月和 7 月的第一个交易日,以调整前最后一个交易日收盘的调整市值来计算调整时的权重上限因子。

当出现样本股临时调整时,以调整前最后一个交易日收盘的调整市值来计算调整时的权重上限因子;当样本股本结构出现显著变化或者其它原因导致其权重发生突变时,将决定是否对权重上限因子进行临时调整。

## 附件三: 上证全指风格指数系列指数编制 方案

一、指数名称和代码

指数名称	上证全指相对成长指数	上证全指相对价值指数	上证全指相对成长与价值
指数简称	全指成长	全指价值	全指 R 价值
英文名称	SSE Large&Mid&Small Cap Growth Index	SSE Large&Mid&Small Cap Value Index	SSE Large&Mid&Small Cap Relative Growth Index
指数代码	000057	000058	000059

二、基日和基点  
上证全指风格指数系列均以 2003 年 12 月 31 日为基日,基点为 1000 点。

三、样本选取方法  
1、样本空间  
上证全指风格指数以上证全指样本为样本空间。  
2、选择方法

2.1 计算价值因子与成长因子的变量数值  
计算用于确定价值和成长特征的变量值。  
成长因子:主营业务收入增长率、净利润增长率和内部增长率  
价值因子:D/P、B/P、CF/P、E/P  
在计算主营业务收入和净利润增长率时,用过去 3 年主营业务收入与净利润数据采用回归方法确定长期增长趋势。

$$a + b \times t$$

其中 a 为斜率, b 为截距, t 为以月份表示的年。  
然后估算出主营业务收入增长率与净利润增长率的平均值

$$G = \frac{a + b \times t}{1 + r}$$

则  $\frac{a + b \times t}{1 + r}$

内部增长率 G = 净资产收益率 × (1 - 红利支付率) 价值因子的计算:

D/P= 过去 1 年的现金红利 / 过去 1 年的日均总市值  
E/P= 过去 1 年的净利润 / 过去 1 年的日均总市值  
B/P= 最近 1 期报表的净资产 / 过去 1 年的日均总市值  
CF/P= 过去 1 年的净现金流量 / 过去 1 年的日均总市值  
2.2 极值处理

为确保用于标准化处理的市值不会因为极值而受到太大影响,首先需对变量进行极值调整。

计算每一个变量时,先对样本空间内所有股票的数值按照升序排列。对于处在下端 5% 或者上端 95% 等级的数值,分别设定为第 5% 等级与 95% 等级的数值。

2.3 缺省值处理  
若某股票的一个或者多个成长因子或者价值因子缺失,则采用该股票同行业的平均值代替。

2.4 计算变量 Z 值  
Z 值是最常见的变量标准化处理方法,它是为了将其与计量单位不同或者标准不同的其它变量组合在一起。确定 Z 值的方法如下:

$$Z = \frac{x - \mu}{\sigma}$$

式中:  $x$  为观测值,  $\mu$  为均值,  $\sigma$  为标准差

计算风格 Z 值  
一个公司的成长 Z 值是 3 个成长因子 Z 值的均值, 价值 Z 值是其 4 个价值因子 Z 值的均值。

成长 Z 值的计算公式:

$$Growth Z = \frac{1}{3} (Z_{D/P} + Z_{B/P} + Z_{E/P})$$

价值 Z 值的计算公式为:

$$Value Z = \frac{1}{4} (Z_{D/P} + Z_{B/P} + Z_{CF/P} + Z_{E/P})$$

3 确定指数样本股

3.3.1 风格指数  
第一步: 选取成长 Z 值最高的 150 只股票作为成长指数样本股;

第二步: 选取价值 Z 值最高的 150 只股票作为价值指数样本股。

3.3.2 相对风格指数  
第一步: 将仅为成长指数样本股股票的成长风格权重设为 1, 价值风格权重设为 0;

第二步: 将仅为价值指数样本股股票的价值风格权重设为 1, 成长风格权重设为 0;

第三步: 将所有样本股按照成长排名/价值排名进行升序排列,并按照下述标准进行风格系数的分配:

成长排名/价值排名 风格权重  
前 1/3 75% 成长 / 25% 价值  
中间 1/3 50% 成长 / 50% 价值  
后 1/3 25% 成长 / 75% 价值

四、指数计算与修正  
上证全指风格指数系列采用派许加权综合价格指数公式进行计算,计算公式如下:

$$报告期指数 = \frac{报告期样本总市值调整市值}{基期} \times 1000$$

其中,调整市值 = ∑(股价×调整股本数)。  
五、样本调整  
上证指数专家委员会一般在每年的 6 月及 12 月的中旬开会审核上证全指风格指数系列, 样本股调整实施时间分别是每年 7 月、1 月份第一个交易日。定期调整指数样本时,上证全指成长指数与上证全指价值指数每次调整比例一般不超过 20%。

当上证全指指数中有样本股被剔除,那么它也将被立即调出相对风格指数。新进股票要按照相对风格指数中确定风格权重的方法加入相应指数中。

上证全指指数样本股临时调整时,风格指数的处理原则是“只出不进”。即,如果上证全指指数中有样本股被剔除,且此样本股属于风格指数,那么它也将被立即调出风格指数,该股票调出后,不再增加新的股票来替代风格指数中被剔除的样本股,风格指数样本股数量短期内少于(在样本股分拆情况下,可能多于 150 只) 150 只,在下次定期调整时调整为 150 只。

## 附件四: 上证企债 30 指数编制方案

一、指数代码、名称  
指数代码:000061  
指数名称:上证企债 30 指数  
指数简称:沪企债 30

指数英文名称:SSE Corporate Bond 30 Index  
指数英文名称:SSE Corporate Bond 30  
二、选择方法  
(一) 样本空间  
• 债券种类: 在上海证券交易所上市交易的非股权连接类的企业债券,包括公司债券和分离交易可转换债券。  
• 剩余期限: 1 年以上。  
• 付息方式: 固定利率付息和一次还本付息。  
• 信用评级: A.A 级及以上。

(二) 选择方法  
步骤 1: 在样本空间中, 首先计算考查区间内日成交金额的中位数,然后将中位数位于后 50% 的样本剔除;  
步骤 2: 对剩余样本按成交金额、交易天数、发行规模综合排名,选取排名前 30 位的样本作为指数样本。

上证企债 30 指数的久期尽量与上证企债指数的久期保持一致,偏差幅度一般不超过 10%。

# 关于深圳本鲁克斯实业股份有限公司代办股份转让股份确权公告

鉴于深圳本鲁克斯实业股份有限公司已于 2009 年 12 月 4 日起终止上市,深圳证券交易所指定光大证券股份有限公司为深圳本鲁克斯实业股份有限公司提供代办股份转让服务。根据中国证监会《关于做好股份有限公司终止上市后续工作的指导意见》和中国证券业协会《证券公司代办股份转让服务业务试点办法》、《退市公司在代办股份转让系统挂牌及重组有关事项的通知》的有关规定,现就深圳本鲁克斯实业股份有限公司原在深圳证券交易所挂牌交易的流通股份(简称“原流通股份”)确权和转托管的有关事项公告如下如下。

一、股份终止上市的情况  
终止上市股票种类: B 股  
股票简称: \*ST 本实 B  
股票代码: 200041

2009 年 11 月 30 日,深圳证券交易所对深圳本鲁克斯实业股份有限公司作出了《关于深圳本鲁克斯实业股份有限公司股票终止上市的决定》(深证上〔2009〕1164 号),深圳本鲁克斯实业股份有限公司从 2009 年 12 月 4 日起终止上市。

深圳本鲁克斯实业股份有限公司终止上市股份退出深圳证券交易所市场登记的相关手续将于近日办理完毕。

2009 年 12 月 1 日深圳证券交易所指定光大证券股份有限公司为深圳本鲁克斯实业股份有限公司提供代办股份转让服务。  
二、深圳本鲁克斯实业股份有限公司原流通股股东办理开户、股份转托管和确权的手续及安排

根据《证券公司代办股份转让服务业务试点办法》的规定,深圳本鲁克斯实业股份有限公司原流通股股份可进行代办股份转让。进行股份转让前,持有深圳本鲁克斯实业股份有限公司原流通股份的投资者(以下简称“原股东”)需办理股份转托管和确权手续。

(一)关于证券账户的相关事宜  
自 2009 年 7 月 6 日起,深圳主板证券账户和非上市股份有限公司股份转让账户(以下简称“股份转让账户”)已合并,故持有退市公司股票的投资者在公司股票退出退市主板登记结算系统后不再开设新的股份转让账户,可直接使用原有的深市 B 股证券账

户或原已开立的股份转让账户办理股份转托管和确权手续,并在代办股份转让系统中交易结算。

(二)原股东的股份确权及转托管  
1、办理股份确权和转托管的开始时间为:2010 年 1 月 8 日。

2、为了简化原股东股份转托管和确权手续,深圳本鲁克斯实业股份有限公司退市时,原股东在具有代办股份转让业务资格的 30 家证券公司托管的流通股份,由光大证券股份有限公司直接向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理股份托管手续。转托管在原股东的深圳 B 股证券账户及原托管证券公司的三板交易单元上,该部分原股东无需向光大证券股份有限公司及托管证券公司支付股份确权手续费。股份直接托管成功的原股东无需再办理股份确权和转托管手续;但原深圳 B 股证券账户无效或已注销等原因,导致股份直接托管失败的原股东仍需自行到光大证券股份有限公司和其他具有代办股份转让业务资格的 30 家代办券商所属营业部办理股份确权和转托管手续,并支付股份确权手续费。

如果原股东持有的深圳 B 股证券账户与股份转让账户均有代办股份转让的挂牌公司流通股份,可以在托管证券公司营业部办理证券账户合并手续,然后在一个证券账户卖出挂牌公司流通股份。

具有代办股份转让业务资格的 30 家证券公司名单及三板交易单元号如下:

序号	证券公司	三板交易单元	序号	证券公司	三板交易单元
1	申银万国	720100	16	国元证券	722000
2	国泰君安	720200	17	东方证券	722100
3	国信证券	720300	18	平安证券	722200
4	长江证券	720700	19	中银证券	722300
5	银河证券	720800	20	上海证券	722400
6	渤海证券	720900	21	西部证券	722500
7	海通证券	721000	22	中投证券	722600
8	广发证券	721100	23	宏源证券	722700
9	兴业证券	721200	24	南京证券	722800
10	招商证券	721300	25	齐鲁证券	722900
11	光大证券	721500	26	山西证券	723100
12	湘财证券	721600	27	中信建投	723200

13	华泰证券	721700	28	东吴证券	723500
14	中信证券	721800	29	东北证券	723700
15	东海证券	721900	30	国海证券	724200

以上 30 家证券公司所属营业部的地址、咨询电话可登录代办股份转让信息披露平台(www.gfzr.com.cn)查询。

3、深圳本鲁克斯实业股份有限公司退市时,原股东在非具有代办股份转让业务资格的其他证券公司托管的流通股份,需要进行股份确权,并转托管至已开立的深圳 B 股证券账户或股份转让账户中。股份确权和转托管可以到光大证券股份有限公司和其他具有代办股份转让业务资格的 30 家代办券商所属营业部办理手续,并支付股份确权手续费。

4、原股东在具有代办股份转让业务资格的 30 家代办券商所属营业部办理股份确权和转托管手续时,须填写《非上市公司股份确权申请表》,除了携带已开设的深圳证券交易所深圳 B 股证券账户原件及复印件外,还要携带以下证件资料:

境内个人:中华人民共和国居民身份证(以下简称身份证)及复印件。委托他人代办的,还须提交经公证的委托代办书、代办人身份证及复印件。

境外个人:有效身份证件及复印件。委托他人代办的,还须提交经公证的委托代办书、代办人有效身份证件及复印件。  
境外机构:商业注册登记证明文件或其他具有同等法律效力的并能证明该机构设立的有效证明文件及复印件、董事会、董事、主要股东或有权人士的授权委托书、授权人有效身份证明文件复印件、经办人有效身份证件及复印件。

根据原股东的自身需要,还可以携带已开设的股份转让账户原件及复印件。

5、原股东可以将股份转托管至具有代办股份转让业务资格的证券公司中的任何一家。

6、办理股份确权手续费用标准:  
(1)股份不需过户  
个人:10 元/每笔;机构:30 元/每笔。按上述标准收取人民币,或根据确权开始第一天国家外汇管理局当天公布的外汇中间价折算

成美元收取。  
(2) 股份需过户  
除按上述标准收费外,还须向过户双方各收取:  
转让股数×转让价格×0.4%(手续费)+ 转让股数×转让价格×印花税率。

7、股份确权过程中遇有特殊情况,可向光大证券股份有限公司咨询。

(三)签订委托协议和开立资金账户  
投资者进行股份转让前,应在阅读《股份转让风险揭示书》并充分了解参与代办股份转让所面临投资风险的基础上,签署《股份转让风险揭示书》,并与证券营业部签订股份转让委托协议书,开立资金账户。

(四)服务时间  
周一至周五(遇有节假日除外):9:00—11:30,13:00—15:00。

三、股份开始转让时间  
按有关规定,自深圳本鲁克斯实业股份有限公司终止上市后的第 45 个工作日,深圳本鲁克斯实业股份有限公司股份开始代办转让。《代办股份转让公告》将在股份开始转让前 5 个工作日通过代办股份转让信息披露平台(www.gfzr.com.cn)发布。

四、特别提请原股东注意的事项  
在代办股份转让公告发布后,投资者进行股份转让时,投资者办理股份确权和转托管手续,其股份通常需要经过两个转让日后方能到账,并可开始转让。敬请相关原股东尽快办理股份确权和转托管手续。

五、咨询电话  
咨询电话:95525/400888788  
咨询时间:周一至周五(遇有节假日除外):9:00—11:30,13:00—15:00。

光大证券股份有限公司  
2009 年 12 月 12 日

## 附件五: 上证沪企指数编制方案

一、指数名称和代码  
指数代码:000062  
指数名称:上证沪企指数  
指数简称:上证沪企  
指数英文名称:SSE Shanghai enterprises Index

二、基日和基点  
上证沪企指数以 2005 年 12 月 31 日为基日,基点为 1000 点。

三、样本空间  
上证沪企指数的样本空间由同时满足以下条件的 A 股股票组成:

●在上海证券交易所上市,注册地在上海的上市公司;  
●上市时间超过 3 个月,除非该股票自上市以来的日均总市值排在沪市前 18 位;  
●非 ST、\*ST 股票,非暂停上市股票;  
●经营状况良好,最近一年无重大违法违规事件,财务报告无重大问题;  
●股价无明显的异常波动或市场操纵。

四、选择方法  
步骤 1: 计算样本空间内股票最近一年(新股为上市以来)的 A 股日均成交额与日均总市值;

步骤 2: 对样本空间内股票在最近一年的 A 股日均成交额由高到低排名,剔除排名后 20% 的股票;

步骤 3: 对剩余股票按照最近一年日均 A 股总市值由高到低进行排名,原则上选取排名在前 50 名的股票作为指数样本。

五、指数计算与修正  
上证沪企指数采用派许加权方法,按照样本股的调整股本数为权重进行加权计算,计算公式为:

$$报告期指数 = \frac{报告期样本总市值调整市值}{基期} \times 1000$$

其中:调整市值 = ∑(股价×调整股本数×权重上限因子),调整股本数的计算方法同上证 180 指数。权重上限因子介于 0 和 1 之间,以使单个样本股权重不超过 15%。

六、定期调整  
上证沪企指数依据稳定性和动态跟踪相结合的原则,每年定期审核两次样本股。样本股调整实施时间为每年 1 月份和 7 月份的第一个交易日。样本股定期调整时设置缓冲区,排名在 40 名内的新样本优先进入,排名在 60 名之前的老样本优先保留。

七、权重上限因子调整  
权重上限因子每年随样本股定期调整而调整两次,调整时间为每年 1 月和 7 月的第一个交易日,以调整前最后一个交易日收盘的调整市值来计算调整时的权重上限因子。

当出现样本股临时调整时,以调整前最后一个交易日收盘的调整市值来计算调整时的权重上限因子;当样本股本结构出现显著变化或者其它原因导致其权重发生突变时,将决定是否对权重上限因子进行临时调整。