

标普道琼斯指数宣布更新标普综合 1500 指数市值指引及标普综合 1500 指数关于市值和流动性资格标准的咨询结果

纽约，2023 年 1 月 4 日：标普道琼斯指数正就标普综合 1500 指数纳入成分股更新市值资格标准。自 2023 年 1 月 4 日起，规模范围将进行如下更新：

| 更新前市值资格标准 | 更新后市值资格标准 |
|--|--|
| 未经调整的公司市值： <ul style="list-style-type: none"> • 146 亿美元或以上（标普 500 指数） • 37 亿美元至 146 亿美元（标普中盘 400 指数） • 8.5 亿美元至 37 亿美元（标普小盘 600 指数） | 未经调整的公司市值： <ul style="list-style-type: none"> • 127 亿美元或以上（标普 500 指数） • 46 亿美元至 127 亿美元（标普中盘 400 指数） • 7.5 亿美元至 46 亿美元（标普小盘 600 指数） |

根据对标普综合 1500 指数关于市值和流动性资格标准[咨询](#)的良好反馈，指数委员会将采纳关于市值指引和经流通量调整流动比率（“FALR”）的建议。上述范围将在每个日历季度初检讨一次，并视需要进行更新，以确保反映当前市况，并以美元范围表示。这些最低市值指引旨在捕捉标普全市场指数（“TMI”）范围的三个月平均累积公司总市值，大致如下累积百分位：

- 标普 500 指数——排名前 85%
- 标普中盘 400 指数——排名前 85%至 93%
- 标普小盘 600 指数——排名前 93%至 99%

在季度检讨中，如果任何综合 1500 指数的新市值范围偏离当前范围 10%或以上，指数委员会将考虑更新所有基础指数的市值范围。如有需要，更新将正式公布，并立即生效。

通过公司总市值标准的公司，证券的流通市值亦须达到相关指数最低公司总市值限值的至少 50%。

对市值指引的这些调整可能导致标普综合 1500 指数的换股率增加，因为这些指数随着时间的推移会逐渐反映出基础指数的市值指引范围变化。

FALR 比率资格要求将从 1.00 降至 0.75，反映出已宣布纳入综合 1500 指数的成分股的市场流动性增加。

为提高清晰度，美国指数编制方法中的流动性资格标准将进行更新，以表明 FALR 计算中仅包含美国综合交易量，如果上市公司在美国交易所没有 365 个日历日的交易历史，则就指数而言被视为在美国注册的公司的美国年化交易量将截至评估日。“所有交易场所（包括历史数值）”的表述将被删除。

| 更新前 FALR 资格标准 | 更新后 FALR 资格标准 |
|--|---|
| 股票在纳入标普综合 1500 指数时经流通量调整流动比率（“FALR”）必须大于或等于 1.0。 | 股票在纳入标普综合 1500 指数时经流通量调整流动比率（“FALR”）必须大于或等于 0.75。 |

需要提醒的是，市值资格标准是用于衡量指数的新增成分股，而非衡量持续成分股。因此，除非持续的情况导致有必要变更指数，否则看似违反指数纳入标准的指数成分股不会被剔除。

可追溯至 2007 年的市值范围历史载于美国指数编制方法附录 A。美国指数编制方法文件将予以更新，以反映该等变动。有关更多详情，请浏览我们的网站 www.spglobal.com/spdji。

有关标普道琼斯指数的更多信息，请浏览 www.spglobal.com/spdji

有关标普道琼斯指数

标普道琼斯指数是全球最大的基于指数之重要概念、数据和研究的信息供应商，拥有标普 500 指数®和道琼斯工业平均指数®等标志性的金融市场指标。投资于以本公司指数作为基准的金融产品的资产总值，高于以全球其他指数作基准的金融工具。自 1884 年查尔斯·道创立第一个指数以来，标普道琼斯指数一直致力创新和开发各种资产类别的指数，为投资者奠定衡量市场和进行交易的方式。

标普道琼斯指数是标普全球（NYSE: SPGI）旗下公司，标普全球为个人、公司和政府提供重要信息，助其作出精明果断的决策。欲了解更多信息，请浏览 www.spdji.com。

详情请浏览：

标普道琼斯指数

index_services@spglobal.com

媒体咨询

spdji.comms@spglobal.com