

## 关于标普综合 1500 指数成分股的可投资权重因子标准的 咨询结果

纽约，2019 年 4 月 25 日：标普道琼斯指数已就标普综合 1500 指数可能的变更向投资界成员进行咨询。

根据现行编制方法，标普综合 1500 指数成分股的可投资权重因子（“IWF”）至少须达到 0.50。为扩大指数的潜在候选成分股范围，同时确保标普综合 1500 指数的成分股对其将加入的指数而言具有一定程度的重要性，标普道琼斯指数将用额外的市值规模标准取代 IWF 规则，以使合格候选成分股必须满足以下条件：

1. 其公司总市值达到标普综合 1500 指数各指数设定的限值。
2. 其证券流通市值（“FMC”）至少达到相应指数的最低公司总市值限值的 50%。

为清楚起见，下表概述了所作的变更。

指数	成分股的市值和 IWF 标准	
	变更前	变更后
标普 500 指数	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 未经调整公司（总）市值至少为 82 亿美元</li> <li>• IWF 为 0.50</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 未经调整公司（总）市值至少为 82 亿美元</li> <li>• 经调整证券（FMC）市值至少为 41 亿美元</li> </ul>
标普中盘 400 指数	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 未经调整公司（总）市值为 24 亿美元至 82 亿美元</li> <li>• IWF 为 0.50</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 未经调整公司（总）市值为 24 亿美元至 82 亿美元</li> <li>• 经调整证券（FMC）市值至少为 12 亿美元</li> </ul>
标普小盘 600 指数	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 未经调整公司（总）市值为 6 亿美元至 24 亿美元</li> <li>• IWF 为 0.50</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 未经调整公司（总）市值为 6 亿美元至 24 亿美元</li> <li>• 经调整证券（FMC）市值至少为 3 亿美元</li> </ul>

该等变更将于 2019 年 5 月 1 日（星期三）开市前生效。

欲了解更多关于标普道琼斯指数的详情，请浏览：[www.spdji.com](http://www.spdji.com)。

## 关于标普道琼斯指数

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。全球投资于我们指数产品的资产总值超过其他任何指数供应商。自1884年查尔斯·道发明第一个指数以来，标普道琼斯指数一直致力于创新和开发各种资产类别的指数，为投资者提供衡量市场和交易状况的有效方式。

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](http://www.spdji.com)。

### 有关更多信息：

#### 标普道琼斯指数

[index\\_services@spglobal.com](mailto:index_services@spglobal.com)