

华证微盘行业等权低波动指数编制方案

一、指数名称和代码

指数名称：华证微盘行业等权低波动指数

指数简称：微盘行业等权低波

英文名称：SSI Micro Cap Sector Equal Weight Low Volatility Index

英文简称：Micro Cap Sector Equal Weight Low Volatility

指数代码：992139

二、指数基日和基点

该指数以 2012 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1. 样本空间

同华证微盘指数样本中的沪深 A 股

2. 选样方法

将样本空间中的股票全部纳入成分股。

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 （股价 × 调整股本数 × 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，以使样本按照行业间等权，行业内波动率倒数加权。

五、指数样本和权重调整

1. 定期调整

指数样本每季度调整一次，调整实施时间为每年 3 月、6 月、9 月和 12 月的第 10 个交易日。

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样本进行调整。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。