

华证陆股通重仓 300 指数编制方案

一、指数名称和代码

指数名称：华证陆股通重仓 300 指数

指数简称：陆股通重仓 300

英文名称：SSI Northern Holdings Heavily 300 Index

英文简称：Northern Holdings 300

指数代码：995007

二、指数基日和基点

该指数以 2016 年 6 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1. 样本空间

华证全指指数样本空间中的沪深 A 股。

2. 可投资性筛选

对样本空间的 A 股，过去 1 年的日均成交金额位于其所在证券交易所全部上市证券的前 80%。

3. 选样方法

在境外投资者持股市值占比超过 0.01% 的样本空间证券中，按照持股市值从高到低排序，选择排名靠前的不超过 300 只证券作为样本。

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=∑（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，以使样本按照境外投资者持股市值加权。

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 1 月、4 月、7 月和 10 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。