

华证 A 股疫苗产业主题指数编制方案

一、指数名称和代码

指数名称：华证 A 股疫苗产业主题指数

指数简称：A 股疫苗产业

英文名称：SSI A-Share Vaccine Industry Thematic Index

英文简称：SSI A-Share Vaccine Industry

指数代码：995076

二、指数基日和基点

该指数以 2018 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

同华证全指指数样本空间中的沪深 A 股

2. 可投资性筛选

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

- (1) 在样本空间中选取业务涉及疫苗耗材、疫苗设备、疫苗研发制造和疫苗运输等的疫苗产业上市公司证券作为备选样本；
- (2) 在剩余样本中按照行业代表性、成长性、研发能力和盈利能力进行等权打分：

- a. 行业代表性：rank(过去 3 个月日均总市值)；
- b. 成长性 rank(营业收入 TTM 环比)*0.5+rank(利润 TTM 环比)*0.5；
- c. 研发能力：rank(过去 3 年的研发费用均值)；
- d. 盈利能力 rank(销售毛利率)。

(3) 根据剩余样本公司的主营业务收入、主营业务类型等指标确定与疫苗产业业务的关联度，将样本分为四档，并根据档位排名打分；

(4) 根据 c 和 d 中的得分等权计算综合得分，选取综合得分前 30 的证券作为指数样本若不足 30 只则全部计入。

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。同时，根据指数样本公司的主营业务收入、主营业务类型等指标确定与疫苗产业业务的关联度，将样本分为四档，相应自由流通市值调整系数分别为 1、0.75、0.25 和 0.125，权重上限分别为 15%、10%、3%和 1%，且前五大样本权重合计不超过 60%。

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。每次调整的样本比例一般不超过 30%。

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。