

## 华证陆港元宇宙产业主题指数编制方案

### 一、指数名称和代码

指数名称：华证陆港元宇宙产业主题指数

指数简称：元宇宙产业

英文名称：SSI A-HK Share Metaverse Industry Thematic Index

英文简称：SSI Metaverse Industry

指数代码：995091

### 二、指数基日和基点

该指数以 2021 年 5 月 15 日为基日，以 1000 点为基点。

### 三、样本选取方法

#### 1. 样本空间

内地市场：同华证全指指数样本空间中的沪深 A 股

香港市场：同华证港股通综合指数的样本空间

#### 2. 可投资性筛选

(1) 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%；

(2) 对样本空间的港股，过去 1 年的日均成交金额不少于 2000  
万港元。

#### 3. 选样方法

(1) 在符合上述可投资性筛选条件的样本空间内，选取业务涉及

元宇宙底层技术、前端设备制造和场景内容等领域的上市公司证券作为备选样本，其中：

- a. 底层技术包括：数字认证、人工智能和视觉处理芯片等；
- b. 前端设备包括：AR、VR 等智能设备；
- c. 场景内容包括：线上办公、线上娱乐和数字化工业等。

(2) 在备选样本中根据市值排名和业务相关度排名等权计算综合排名，选取综合排名靠前的 100 家上市公司证券作为最终样本若不足 100 只则全部计入。其中，业务相关度排名由样本公司的主营业务收入和主营业务类型等指标确定。

#### 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=Σ（股价×调整股本数×权重因子×汇率）。汇率、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。加权方式采用成长因子倾斜加权和分档加权相结合的方式。首先通过成长倾斜因子调整自由流通市值，再根据指数样本公司的业务收入和主营业务类型等指标，确定与元宇宙产业的相关度，将样本分为四档并对成长倾斜因子调整后的自由流通市值进行二次调整。其中，四档相应调整系数分别为 1、0.75、0.5 和 0.25，权重上限分别为 15%、10%、5%和 3%，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。