

华证 A 股区域振兴发展主题指数编制方案

一、指数名称和代码

指数名称：华证 A 股区域振兴发展主题指数

指数简称：A 股区域振兴发展

英文名称：SSI A-Share Regional Developing Index

英文简称：SSI A-Share Regional Developing

指数代码：995105

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

同华证全指指数样本空间中的沪深 A 股。

2. 可投资性筛选

（1）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）剔除 ESG 尾部风险类型为“警告”或“严重警告”的上市公司。

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，按照所处省份经济实力、公司影响力、产业基本面三个角度进行打分：

- a. 所处省份经济实力：rank（所在省份人均 GDP，从低到高排序）；
- b. 公司影响力：rank（总市值）；
- c. 产业基本面：以下四个方面等权计算：
 - i. 员工总数：rank（员工总数）；
 - ii. 纳税总额：rank（所得税+营业税及附加的合计）；
 - iii. 经营情况：rank(营业收入)*0.5+rank(净利润)*0.5；
 - iv. 创新能力：rank（研发支出）；

（2）根据（1）中的各项得分等权计算综合得分，选取综合得分前 100 的证券作为指数样本。

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，单个样本权重不超过 5%，单一省份累计权重不超过 20%。

五、指数样本和权重调整

1. 定期调整

指数样本每半年调整一次，调整实施时间为每年 6 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。