

华证陆港资产纾困主题指数编制方案

一、指数名称和代码

指数名称：华证陆港资产纾困主题指数

指数简称：资产纾困

英文名称：SSI A-HK Share Asset Bailout Thematic Index

英文简称：SSI Asset Bailout

指数代码：995139

二、指数基日和基点

该指数以 2020 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：同华证全指指数的样本空间

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股票的前 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，剔除持续亏损

的上市公司；

- (2) 选择主营业务为不良资产管理、涉及不良资产管理相关领域产业链的上市公司证券，包括但不限于持牌 AIC 母公司及持牌 AMC、AIC 参股超过 5% 的上市公司证券；
- (3) 按照业务相关性进行分档，将 1、2、3 档证券直接纳入最终样本，4 档证券进行市值排名，共选取前 50 只作为最终指数样本，若不足 50 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 = \sum （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。根据指数样本公司与资产纾困业务的关联度，将样本分为四档。样本按照分档加权，各档位调整系数分别为 1、0.75、0.5、0.25，权重上限分别为 15%、15%、5% 和 5%，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。