

华证蓝色经济主题指数编制方案

一、指数名称和代码

指数名称：华证蓝色经济主题指数

指数简称：蓝色经济

英文名称：SSI Blue Economy Thematic Index

英文简称：SSI Blue Economy

指数代码：995153

二、指数基日和基点

该指数以 2011 年 12 月 30 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) 在符合上述可投资性筛选条件的样本空间内，选取业务涉及海洋渔业、滨海旅游、海上新能源、海洋油气、海水淡化、海洋化工、海洋生物药品、海洋工程建筑、海洋运输、海洋装备制造、海洋国防、海洋服务等的公司证券作为备选样本；

- (2) 在备选样本中按照营收 TTM 环比和利润 TTM 环比进行等权打分，计算综合排名；
- (3) 选取综合得分前 100 的证券作为指数样本，若不足 100 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）。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。根据指数样本公司的主营业务收入、主营业务类型确定与海洋经济业务的关联度，将样本分为核心组和非核心组。个股按照分组等权计算，分组权重之和分别为 80% 和 20%。

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。