

华证国企示范企业指数编制方案

一、指数名称和代码

指数名称：华证国企示范企业指数

指数简称：国企双示范

英文名称：SSI State-Owned Role Model Enterprises Index

英文简称：SSI SOEs Double Role Model

指数代码：995160

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

同华证国企指数的样本

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，选取本公司或核心子公司为国资委世界一流示范企业（含集团主业公司）和世界一流专精特新示范企业的证券作为备选样本；

(2) 将备选样本按照过去 3 个月日均总市值由高到低排名，选取

前 100 只作为最终样本，如数量不足 100 只则全部纳入。

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，以使样本按照自由流通市值对数加权。单个样本权重不超过 15%，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。