

华证国企专精特新 50 指数编制方案

一、指数名称和代码

指数名称：华证国企专精特新 50 指数

指数简称：国企专精特新

英文名称：SSI State-Owned Enterprises Specialized Fined Peculiar
and Innovative 50 Index

英文简称：SSI SOEs SFPI

指数代码：995166

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名列国资委世界一流专精特新示范企业名单和工信部专精特新小巨人企业名单的证券作为备选样本；

- （2）剔除备选样本中 ROE（TTM）排名后 20%的证券；
- （3）将剩余备选样本按照营业收入增长率（TTM）、毛利率（TTM）和过去 3 个月日均总市值由高到低综合排名，选取前 50 只作为最终样本，如数量不足 50 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=Σ（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，以使样本按照对数自由流通市值加权，且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。