

## 华证专精特新绿色制造指数编制方案

### 一、指数名称和代码

指数名称： 华证专精特新绿色制造指数

指数简称： 专精特新绿色制造

英文名称： SSI SRDI & Green Manufacturing Index

英文简称： Green SRDI

指数代码： 997203

### 二、指数基日和基点

该指数以 2018 年 12 月 7 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 年的日均成交金额排名全市场 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，选取母公司或其核心控股子公司被工信部列为国家级专精特新，且是国家级绿色制造的上市公司作为备选样本；

（2）在上述备选样本中，选取总市值较大的股票，超过 100 只，  
则选取总市值最大的前 100 只股票。

#### 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，以使得单个样本权重不超过 10%。

#### 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。指数样本定期调整时采用缓冲区规则，排名在前 80% 的候选新样本优先入选，排名在前 120% 的老样本优先保留。

##### 2. 临时调整

特殊情况下将对指数样本进行调整。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。