

中证智能制造主题指数编制方案

中证智能制造主题指数从沪深 A 股中选取为智能制造提供关键技术装备和核心支撑软件，以及应用智能制造进行生产的上市公司股票作为样本股，以反映智能制造主题上市公司股票的整体表现。

一、 指数名称及代码

指数名称：中证智能制造主题指数

指数简称：智能制造

英文名称：CSI Intelligent Manufacturing Index

英文简称：CSI IM

指数代码：930850

二、 指数基日与基点

该指数以 2012 年 6 月 29 日为基日，以 1000 点为基点。

三、 样本选取方法

1、 样本空间

中证全指指数样本股

2、 选样方法

(1) 对样本空间内的股票按照最近一年的 A 股日均成交金额由高到低进行排名，剔除排名后 20% 的股票；

(2) 选取属于如下中证三级行业分类的股票：机械制造、电气设备、软件

开发、信息技术服务、互联网服务、电脑与外围设备、电子设备、半导体、通信设备等；

(3) 选取涉及以下智能制造相关业务的上市公司股票作为待选样本：

- 为智能制造提供关键技术装备：数控机床与工业机器人、增材制造装备、智能传感与控制装备、智能检测与装配装备、智能物流与仓储装备；
- 为智能制造提供核心支撑软件：工业控制与业务管理软件、大数据与云计算；
- 智能制造应用领域：电子信息领域工艺与装备等；

(4) 在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 100 名的股票构成指数样本股。

四、 指数计算

中证智能制造主题指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本股的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ ，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，以使单个样本股权重不超过 5%。

五、 指数样本和权重调整

1、定期调整

中证智能制造主题指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整,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进行临时调整。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、分拆等情形的处理,参照计算与维护细则处理。