

中证建行资管高端制造指数编制方案

中证建行资管高端制造指数从沪深市场中选取研发投入较高、经营状况较好的高端制造行业上市公司证券作为指数样本，以反映高端制造领域上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证建行资管高端制造指数

指数简称：建行资管高端制造

英文名称：CSI CCB Asset Management High-End Manufacturing Index

英文简称：CCB Asset Management High-End Manufacturing

指数代码：931556

二、指数基日和基点

该指数以 2014 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

同中证全指指数的样本空间

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 对样本空间内剩余证券，选取医药制造业，通用设备制造业，专用设

备制造业，汽车制造业，铁路、船舶、航空航天和其它运输设备制造业，电气机械及器材制造业，计算机、通信和其他电子设备制造业，仪器仪表制造业等行业的高新技术企业证券作为待选样本；

(3) 计算待选样本研发投入指标，并对各细项指标进行标准化打分和极值处理。研发投入得分等于三个细项指标得分的算术平均。剔除研发投入得分排名后 30% 的证券；

指标名称	细项指标构成	考察时间
研发投入	研发支出/营业收入	过去三年
	研发支出/日均总市值	过去三年
	研发人员占比	过去三年平均

(4) 计算剩余证券营业收入同比增长率和经行业中性处理的销售毛利率 (TTM)，剔除两者排名均位于后 50% 的证券；

(5) 将剩余证券按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 100 名的证券作为指数样本。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使单个样本权重不超过 5%。

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，样本调整实施时间分别为每年 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、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。