

## 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市场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证券作为指数样本，以反映沪深市场智能制造主题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、指数基日和基点

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

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，选取机械制造、电力设备、软件开发、电子、通信设备等领域的上市公司证券；

(3) 选取涉及以下智能制造相关业务的上市公司证券作为待选样本：

- 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：

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

其中，调整市值 =  $\sum$ (证券价格×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。