

中证智选船舶产业指数编制方案

中证智选船舶产业指数选取 40 家业务涉及船用材料、船舶制造、船舶配套、航运等船舶产业相关领域的代表性上市公司证券作为指数样本,反映船舶产业领域上市公司的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称: 中证智选船舶产业指数

指数简称: 智选船舶产业

英文名称: CSI Shipbuilding Industry Custom Index

英文简称: Shipbuilding Industry Custom

指数代码: 932420

二、指数基日和基点

该指数以 2019 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、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的上市公司证券中，选取业务涉及船舶产业或中船集团控股的上市公司证券作为待选样本，船舶产业相关业务包括但不限于船用材料、船舶制造、船舶配套、航运以及其他船舶相关细分产业；

(2) 剔除过去三年净资产收益率均值为负数且位于待选样本后 5%的证券，待选样本中过去一年日均总市值排名前 10 的予以豁免；

(3) 从船舶制造、船舶配套领域的待选样本中，选取过去一年日均总市值排名靠前的 40 只上市公司证券作为指数样本；若上述证券数量不足 40 只，则将其他待选样本按照过去一年日均总市值排名依次纳入指数样本，直至样本数量达到 40 只。

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，以使船舶制造、船舶配套领域的单个样本权重不超过 15%，其余单个样本权重不超过 2%且合计权重不超过 10%，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，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。每次调整的样本数量比例一般不超过 20%。

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。