

## 华证制造业新星策略指数编制方案

### 一、指数名称和代码

指数名称：华证制造业新星策略指数

指数简称：制造业新星

英文名称：SSI Manufacturing Rising Star Strategy Index

英文简称：Manufacturing Rising Star

指数代码：995118

### 二、指数基日和基点

该指数以 2012 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

同华证全指指数的样本空间

#### 2. 可投资性筛选

过去 1 年的日均成交金额位于其所在证券交易所全部上市证券的前 80%。

#### 3. 选样方法

(1) 在符合上述可投资性筛选条件的样本空间中，选择同时符合以下条件的股票作为备选样本：

- a. 属于证监会行业分类制造业门类下的公司，不包含农副产品加工业、食品制造业、酒饮料和精制茶制造业、医

药制造业几个大类行业；

- b. 近 8 个季度至少有 6 个季度单季度营业收入同比增速为正，且最近两个季度不全为负。

(2) 在备选样本中，按照上市公司主体成立日期排序，选择成立日最晚的 20% 的股票，再在其中选择成长因子（营业收入 TTM 环比增速、净利润 TTM 环比增速、ROE\_TTM）和研发费用综合得分最高的 50 只股票作为最终样本。

#### 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 =  $\sum$ （股价  $\times$  调整股本数  $\times$  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，以使样本按照 Alpha 动量因子倾斜加权，单个样本权重不超过 5%，单个行业权重不超过 30%。

#### 五、指数样本和权重调整

##### 1. 定期调整

指数样本每季度调整一次，调整实施时间为每年 3 月、6 月、9 月和 12 月的第 10 个交易日，每次调整的样本比例一般不超过 30%。

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样本进行调整。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。