

华证船舶高端制造产业主题指数编制方案

一、指数名称和代码

指数名称：华证船舶高端制造产业主题指数

指数简称：船舶制造

英文名称：SSI Ship High-End Manufacturing Industry Thematic

Index

英文简称：SSI Ship Manufacturing

指数代码：995172

二、指数基日和基点

该指数以 2020 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内，选取主营业务涉及船舶制造、船舶设计、船用原材料、舾装设备、船舶动力系统的上市公司证券作为备选样本；

（2）在备选样本中，按照过去 3 个月日均总市值和成长因子由高到低综合排名，选取前 50 只作为最终样本，如数量不足 50 只则全部纳入。其中成长因子由 ROE（TTM）、净利润增长率（TTM）和营业收入增长率（TTM）三个指标的标准值等权相加而得。

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 × 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，对于船舶制造相关业务收入占比不低于 50% 的上市公司证券，单个样本权重不超过 10%；对于船舶制造相关业务收入占比低于 50% 的上市公司证券，单个样本权重不超过 3%。

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，调整实施时间为每年 6 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。