

中国智能资产指数编制方案

一、指数名称与代码

- 1、指数名称：中国智能资产指数
- 2、指数简称：智能资产
- 3、英文名称：China Intellectual Property Index
- 4、英文简称：China IP Index
- 5、指数代码：000983

二、指数基期与基点

中国智能资产指数以 2006 年 6 月 30 日为基日，以该日所有股票样本的调整市值为基期，基点均为 1000 点。

三、样本选取方法

1、样本空间

以沪深两市全部A股（非ST、*ST股）作为样本空间。

2、选样方法

智能资产是指企业无形资产中以技术实力为核心的相关资产的总和。

首先，对样本空间的股票进行智能资产的评估，并根据评估得分（即 IPV 值）由高到低排名。

其次，在样本空间中剔除如下的股票：

- 过去一年日均成交金额排名在样本空间后 20%的股票；
- IPV 排名在样本空间后 75%的股票；
- 过去三年有两年亏损且当年 IPV 排名在 120 名以后的股票；
- 过去三年有一年亏损且当年 IPV 排名在 150 名之后的股票；
- 最近一年亏损的股票；

- 过去一年日均总市值排名前 20 位的股票。

根据证监会行业分类标准，将样本空间的股票按照门类和辅助类划分为 22 个行业，再根据样本空间中每个行业样本数占比分配样本只数，具体方法是：第 i 行业样本配额 = 样本空间中第 i 行业所有股票数 / 样本空间所有股票数 × 180；

按照行业的样本配额分配只数，在行业内选取 IPV 值排名靠前的股票。

对各行业选取的样本作进一步调整，使成份股总数为 180 家。

四、指数计算

采用派许加权综合价格指数公式进行计算，公式如下：

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

其中，调整市值 = \sum (股价 × 调整股本数 × IPV 调整因子)，调整股本数的计算方法同沪深 300 指数。IPV 调整因子 = IPV 值 / 调整市值 × 10000000。

五、指数修正

同沪深 300 指数

六、样本股定期和临时调整

中国智能资产指数每年调整一次样本股，样本股调整实施时间是每年 7 月的第一个交易日。定期调整时，每次调整比例一般不超过 20%。

当样本股公司有特殊事件发生，以致影响指数代表性和可投资性时，对指数样本股进行相应调整。