

中证沪港深人工智能 50 指数编制方案

中证沪港深人工智能 50 指数从内地与香港市场为人工智能提供基础资源、技术支持以及应用的上市公司证券中选取 50 只市值较高、成长能力较好的上市公司证券作为指数样本，以反映内地与香港市场人工智能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：中证沪港深人工智能 50 指数

指数简称：SHS 人工智能 50

英文名称：CSI SH-HK-SZ Artificial Intelligence 50 Index

英文简称：SHS AI 50

指数代码：931487（人民币）/931488（港元）

二、指数基日和基点

该指数以 2014 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

内地市场：同中证全指指数的样本空间

香港市场：同中证港股通综合指数的样本空间

2、选样方法

（1）对样本空间内的内地市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；对样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日

均成交金额不足 1000 万港元的证券；

(2) 对样本空间内内地市场证券，剔除股权质押比例最高 5% 的证券；

(3) 剔除过去三年主营业务收入增速为负的证券；

(4) 对样本空间内剩余证券，选取涉及以下人工智能相关业务的上市公司证券作为待选样本：

- 为人工智能提供基础资源：专用计算芯片、高性能计算机等设备；
- 为人工智能技术发展提供技术支持：云计算、大数据、机器视觉、语音语义识别等技术或服务；
- 人工智能应用领域：智能安防、智能交通、智能家居、智能医疗、智能穿戴等领域；

(5) 在上述待选样本中，按下列公式计算每只证券的综合得分并由高到低排名，选取排名前 50 的证券作为指数样本 (Rank 表示该指标的升序百分比排名)：

$$\text{综合得分} = \text{Rank(R\&D)} * 40\% + \text{Rank(Growth)} * 30\% + \text{Rank(MV)} * 30\%$$

其中：

- R&D = 过去两年公司总研发投入/过去两年公司总营业收入；
- Growth = 过去三年公司主营收入增长率；
- MV = 过去一年证券日均总市值。

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 = $\sum$ (证券价格 × 调整股本数 × 权重因子 × 汇率)。汇率、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，以使指数样本采用综合得分调整后的自由流通市值加权，且单个样本权重不超过 10%，前五大样本权重合计不超过 40%。

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。

权重因子随样本股定期调整而调整，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。当港股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时，指数将相应调整。