

中证科创创业机器人指数编制方案

中证科创创业机器人指数从科创板和创业板中选取 40 只能够为机器人智能化提供感知、规划决策和运动控制与执行功能所需的软件和硬件产品，以及应用场景类产品的上市公司作为指数样本，以反映上述板块中智能机器人主题相关的上市公司整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证科创创业机器人指数

指数简称：科创创业机器人

英文名称：CSI STAR&CHINEXT Robot Index

英文简称：STAR&CHINEXT Robot

指数代码：932438

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

指数样本空间由满足以下条件的科创板和创业板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成：

(1) 上市时间超过 6 个月，除非该证券自上市以来的日均总市值在沪深市场中排名前 30 位。

(2) 非 ST、*ST 证券。

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证券，选取能够为机器人智能化提供感知、规划决策以及运动控制与执行功能所需的软件和硬件产品，以及应用场景类产品的上市公司作为待选样本，相关领域涵盖：

- 机器人智能化重点产品和部组件：包括传感器、执行器、控制器等；
- 机器人智能化关键技术攻关领域：包括 AI 芯片、规划决策算法、空心杯电机、无框力矩电机等；
- 应用场景类产品：包括单一场景机器人产品（如扫地机器人等）、通用场景机器人产品等；

(2) 在待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排序，选取排名靠前的 40 只证券作为指数样本。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使业务与机器人智能化重点产品和部组件相关及通用场景机器人产品相关的上市公司证券单个样本权重不超过 10%；业务属于机器人智能化关键技术攻关领域及单一场景机器人产品制造的上市公司证券单个证券权重不超过 3%，合计权重不超过

20%；单个板块权重占比不超过 80%。

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。