

# 中证科创创业人工智能指数编制方案

中证科创创业人工智能指数从科创板和创业板中选取 50 只业务涉及人工智能基础资源、人工智能技术以及人工智能应用领域的上市公司证券作为指数样本，以反映上述板块中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：中证科创创业人工智能指数

指数简称：科创创业 AI

英文名称：CSI STAR&CHINEXT Artificial Intelligence Index

英文简称：STAR&CHINEXT AI

指数代码：932456

## 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，选取涉及以下人工智能业务的上市公司证券作为待选样本：

- 人工智能基础资源：专用计算芯片、高性能计算机等设备；
- 人工智能技术：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。

(2) 在待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排序，选取排名前 50 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，以使单个样本权重不超过 10%，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。