

## 中证人工智能产业指数编制方案

中证人工智能产业指数从沪深市场为人工智能提供基础资源、技术以及应用支持的公司中，根据人工智能业务占比、成长水平和市值规模构建指标体系，选取 50 只最具代表性上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场人工智能产业上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证人工智能产业指数

指数简称：人工智能

英文名称：CSI Artificial Intelligence Industry Index

英文简称：Artificial Intelligence

指数代码：931071

### 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

同中证全指指数的样本空间

#### 2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 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；

(3) 计算上述剩余证券的综合得分，综合得分=过去一年日均总市值×收入占比得分×营收增速得分。其中，营收增速得分为过去两年平均营业收入增速的标准化得分，收入占比得分按照如下规则计算：

- 人工智能业务收入占比大于等于 70% 的公司：收入占比得分为 1；
- 人工智能业务收入占比大于等于 30% 的公司且小于 70% 的公司：当该公司的行业属于互联网服务或软件开发，则收入占比得分为 1；当该公司的行业属于其它行业，则收入占比得分为人工智能业务收入占比值；
- 人工智能业务收入小于 30% 的公司：收入占比得分为人工智能业务收入占比值；

(4) 在上述剩余证券中，选取综合得分最高的 50 只上市公司证券作为指数样本。

#### 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，以使样本采用综合得分调整后自由流通市值加权，综合得分调整后自由流通市值加权=收入占比得分  $\times$  营收增速得分  $\times$  自由流通市值，单个样本权重不超过 10%，过去两年平均营业收入增速为负且小于行业平均的单个样本权重不超过 5%。

## 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。