

创业板人工智能指数编制方案

为反映创业板人工智能相关上市公司的股价变化情况，丰富指数化投资工具，编制创业板人工智能指数。

一、代码与名称

指数名称：创业板人工智能指数

指数简称：创业板人工智能

英文名称：SZSE ChiNext Artificial Intelligence Index

英文简称：CNTAI50

指数代码：970070

二、基日与基点

指数基日为 2018 年 12 月 28 日，基点为 1000 点。

三、选样空间

在深圳证券交易所创业板上市交易且满足下列条件的所有 A 股：

1. 非 ST、*ST 股票；
2. 上市时间超过 6 个月；

3. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
4. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
5. 考察期内股价无异常波动；
6. 公司业务涉及存算和网络设备、数据和软件服务、场景应用等人工智能相关领域。

四、选样方法

首先，计算入围选样空间股票在最近半年的 A 股日均总市值和 A 股日均成交金额；

其次，剔除最近半年 A 股日均成交金额排名后 10% 的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年的 A 股日均总市值从高到低排序，选取前 50 名股票作为指数样本股。

五、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本股权重调整”。

六、样本股调整

1. 样本股定期调整

指数样本股每半年调整一次，于每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。

每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%。排名在样本数 70% 范围之内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数 130% 范围之内的原样本股按顺序优先保留。

在确定新入选样本股后，在剩余股票中按日均总市值从高到低排序，选取样本数量 5% 的股票作为备选样本股。

2. 样本股临时调整

样本股出现终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

样本股公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同创业板指。

七、样本股权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使每次样本股定期调整时，存算和网络设备、数据和软件服务领域的单只样本股权重不超过 10%，场景应用领域的单只样本股权重不超过 2%。

权重调整因子每年调整 2 次,于样本股定期调整时实施。
在下一个定期调整日之前,权重调整因子一般固定不变。

当出现样本股临时调整时,新进样本股继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的权重,据此计算新进股票的权重调整因子。