

# 国证机器人产业指数编制方案

为反映沪深北交易所机器人产业上市公司的证券价格变化情况，丰富指数化投资工具，编制国证机器人产业指数。

## 一、代码与名称

指数名称：国证机器人产业指数

指数简称：机器人产业

英文名称：CNI Robot Index

英文简称：CNIROBOT

指数代码：980022

## 二、基日与基点

指数基日为 2014 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

## 三、选样空间

满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证：

1. 非 ST、\*ST 证券；
2. 科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年，其他证券上市时间超过 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. 考察期内证券价格无异常波动；
6. 公司业务涉及机器人本体、核心零部件和其他机器人产业相关领域。

#### 四、选样方法

首先，对入围证券按照最近半年日均成交金额从高到低排序，剔除排名后 10% 的证券；

最后，对剩余证券按照最近半年日均总市值从高到低排序，选取前 50 名证券作为指数样本。

#### 五、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁计算：

当日指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本当日成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本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、样本权重调整”。

#### 六、样本调整

## 1. 样本定期调整

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

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

在未入选样本的证券中，在剩余证券中按日均总市值从高到低排序，选取样本数量 5% 的证券作为备选样本。

## 2. 样本临时调整

样本出现终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

样本公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同国证 1000 指数。

## 七、样本权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，机器人本体、核心零部件领域对应样本的自由流通市值调整系数为 1，权重上限为 5%，其他领域对应样本的自由流通市值调整系数为 0.5，权重上限为 3%。

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

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除证券在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进证券的权重调整因子。