

上证科创板新材料指数编制方案

上证科创板新材料指数从科创板市场中选取 50 只市值较大的先进钢铁、先进有色金属、先进化工、先进无机非金属等基础材料以及关键战略材料等领域上市公司证券作为指数样本，反映科创板市场代表性新材料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：上证科创板新材料指数
指数简称：科创材料
英文名称：SSE STAR New Materials Index
英文简称：STAR New Materials
指数代码：000689

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，除非上市以来日均总市值排名在科创板市场前 5 位且上市时间超过 3 个月；
- (2) 非退市风险警示证券。

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，选取业务涉及新材料领域的上市公司证券作为待选样本，包括但不限于以下领域：

- 先进基础材料：先进钢铁材料、先进有色金属材料、先进化工材料、先进无机非金属材料等；
- 关键战略材料：高性能纤维及复合材料、稀土功能材料、先进半导体材料和新型显示材料、新型能源材料、前沿新材料等；

(2) 将待选样本按照过去一年日均总市值由高到低排名，当待选样本数量不足 50 只时，全部纳入，当待选样本数量超过 50 只时，选取排名前 50 的证券作为指数样本

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 = Σ (证券价格 × 调整股本数 × 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%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每季度调整一次，样本调整实施时间分别为每年 3 月、6 月、9 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。