

上证科创板创新成长策略精选指数编制方案

上证科创板创新成长策略精选指数由上海浦东发展银行股份有限公司参与编制，从科创板各行业上市公司中，选取 80 只科技创新能力较强、成长性较好的上市公司证券作为指数样本，反映科创板兼具创新和成长特征的上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证科创板创新成长策略精选指数

指数简称：创新成长策略精选

英文名称：SSE STAR Innovation Growth Strategy Custom Index

英文简称：Innovation Growth Strategy Custom

指数代码：950393

二、指数基日和基点

该指数以 2022 年 12 月 30 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，剔除满足如下任一条件的上市公司，并将剩余证券作为待选样本：

- 各四级行业科技创新评分（市值中性）¹位于后 5%的上市公司证券；
- 过去三年研发投入持续下降；
- 过去三年营业收入持续下降；

(2) 对于上述待选样本，分别计算每只证券的单季度营收同比增速、单季度净利润同比增速、一致预期净利润环比增速、一致预期营业收入环比增速指标在其所属四级行业内的排名百分比得分；

(3) 计算上述指标行业内排名百分比得分的算数平均，得到待选样本的成长综合得分，将成长综合得分由高到底排名，选取排名前 80 名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 = $\sum$ (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

¹ 科技创新评分是基于“科技创新力、团队创新力、股权创新力”三类指标，计算得出的代表科技企业科创实力的得分，评分范围为 0-1000 分，分数越高代表企业的科创实力越强。科创评分（市值中性）是指科创评分对于市值规模对数回归的残差值。

样本按照成长综合得分调整后的自由流通市值加权，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。