

上证科创板综合指数编制方案

上证科创板综合指数由上海证券交易所符合条件的科创板上市公司证券组成指数样本，并将样本分红计入指数收益，反映上海证券交易所科创板上市公司证券在计入分红收益后的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证科创板综合指数

指数简称：科创综指

英文名称：SSE Science and Technology Innovation Board Composite Index

英文简称：STAR Composite Index

指数代码：000680

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

指数样本空间由科创板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成。ST、*ST 证券除外。

2、选样方法

选取样本空间内所有证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{发行股本数} \times \text{权重因子})$ 。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 15%。权重因子于每月第二个星期五的下一交易日或新计入样本权重超过 15% 时调整。在下一个调整日前，权重因子一般固定不变。除数在样本除息等情况时予以修正，具体参见指数计算与维护细则。

五、指数样本调整

上市以来日均总市值排名在科创板前 10 位的证券于上市满三个月后计入指数，其他证券于上市满一年后计入指数。样本被实施风险警示的，从公告将被实施风险警示措施次月的第二个星期五的下一交易日起将其从指数样本中剔除；被撤销风险警示的证券，从被撤销风险警示措施次月的第二个星期五的下一交易日起将其计入指数。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、停牌等情形的处理，参照指数计算与维护细则处理。