

# 上证科创板 200 指数编制方案

上证科创板 200 指数从上海证券交易所科创板中选取市值偏小且流动性较好的 200 只证券作为指数样本。上证科创板 200 指数与上证科创板 50 成份指数、上证科创板 100 指数共同构成上证科创板规模指数系列，反映科创板市场不同市值规模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 200 指数

指数简称：科创 200

英文名称：SSE Science and Technology Innovation Board 200 Index

英文简称：STAR 200

指数代码：000699

## 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；

(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，剔除科创 50 和科创 100 指数样本以及样本空间内过去一年日均总市值排名前 130 名的证券，将剩余证券作为待选样本；

(2) 对待选样本按照过去一年的日均总市值由高到低排名，选取排名在 200 名之前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 =  $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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%，前五大样本权重合计不超过 40%。

## 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。每次调整数量比例原则上不超过 15%。采用缓冲规则，排名在前 160 名的候选新样本优先进入指数，排名在前 240 名的老样本优先保留。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。

指数定期审核时设置备选名单，具体规则参见指数计算与维护细则。当指数因为样本退市、合并等原因出现样本空缺或其他原因需要临时更换样本时，依次选择备选名单中排序靠前的证券作为样本。

## 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。