

上证国新科创板国企指数编制方案

上证国新科创板国企指数从科创板中选取国有企业或国有资本参股且无实际控制人的上市公司证券作为指数样本，反映科创板国有企业或国有资本参股上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证国新科创板国企指数

指数简称：国新科创国企

英文名称：SSE China Reform STAR SOEs Index

英文简称：China Reform STAR SOEs

指数代码：950253

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、选样方法

从样本空间内符合可投资性筛选条件的证券中，选取国有企业或国有资本参股比例不低于 10%且无实际控制人的上市公司证券作为指数样本。

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%；国有资本参股比例不低于 10%且无实际控制人的单个样本权重不超过 5%，合计权重不超过 20%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 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。