

## 中证科创创业 50 指数编制方案

中证科创创业 50 指数从科创板和创业板中选取市值较大的 50 只新兴产业上市公司证券作为指数样本，以反映上述板块中代表性新兴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：中证科创创业 50 指数

指数简称：科创创业 50

英文名称：CSI STAR&CHINEXT 50 Index

英文简称：STAR&CHINEXT 50

指数代码：931643

### 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

中证科创创业 50 指数的样本空间由满足以下条件的科创板和创业板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成：

(1) 上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来的日均总市值在沪深市场中排名前 30 位；

(2) 非 ST、\*ST 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 80%。

## 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，选取新一代信息技术产业、高端装备制造产业、新材料产业、生物产业、新能源汽车产业、新能源产业、节能环保产业、数字创意产业等新兴产业上市公司证券作为待选样本；

(2) 将待选样本按照过去一年日均总市值由高到低排名，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 =  $\Sigma$ (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%，单个板块权重占比不超过 80%。

## 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 10%。采用缓冲区规则，排名在前 40 名的候选新样本优先进入指数，排名在前 60 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。

## 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。