

中证大宗商品股票指数编制方案

中证大宗商品股票指数从中证 800 指数样本中选取总市值最大的 100 家大宗商品类上市公司证券作为指数样本，以反映大宗商品类证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证大宗商品股票指数
指数简称：大宗商品
英文名称：CSI Commodity Equity Index
英文简称：CSI Commodity
指数代码：000979/399979

二、指数基日和基点

该指数以 2004 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 800 指数样本

2、选样方法

(1) 在样本空间内选取有色金属、钢铁、煤炭、化学原料、农用化工、其他非金属材料、纸类与林业产品、种植业、饲料、畜牧产品、渔业产品、综合性石油与天然气企业、燃油炼制、天然气加工等行业的上市公司证券列为大宗商品证券；

(2) 在上述待选样本中,按照过去一年的日均总市值由高到低排名,选取排名在前 100 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,以使所有样本权重相等。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数每半年调整一次,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。每次调整的样本比例一般不超过 10%。

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。