

中证畜牧养殖指数编制方案

中证畜牧养殖指数选取涉及畜禽饲料、畜禽药物以及畜禽养殖等业务的上市公司证券作为样本，以反映畜牧养殖相关上市公司的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证畜牧养殖指数

指数简称：中证畜牧

英文名称：CSI Livestock Breeding Index

英文简称：CSI Livestock Breeding

指数代码：930707

二、指数基日和基点

该指数以 2011 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

同中证全指指数的样本空间

2、选样方法

（1）对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

（2）在剩余样本中，选取涉及畜禽饲料、畜禽药物以及畜禽养殖等业务的上市公司作为待选样本；

(3) 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，选取排名前 50 名的证券构成指数样本，不足 50 只时全部纳入。

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%。

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。