

中证生猪产业指数编制方案

中证生猪产业指数选取 30 只业务涉及生猪养殖、饲料、育种、疫苗、屠宰、猪肉制品等生猪产业链的上市公司证券作为指数样本，以反映生猪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：中证生猪产业指数

指数简称：生猪产业

英文名称：CSI Live Hog Industry Index

英文简称：Live Hog Industry

指数代码：931845

二、指数基日和基点

该指数以 2015 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、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，选取业务涉及生猪养殖、饲料、育种、疫苗、屠宰、猪肉制品等生猪产业链的上市公司证券作为待选

样本;

(2) 在上述待选样本中, 按照过去一年日均总市值由高到低排名, 选取 30 只主营业务为生猪养殖的上市公司证券作为指数样本; 若样本数量不足 30 只, 按照过去一年日均总市值由高到低依次纳入剩余待选样本, 直至样本数量达到 30 只。

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 $\times$ 调整股本数 $\times$ 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, 以使生猪养殖上市公司证券单个样本权重不超过 15%, 其余单个样本权重不超过 5%, 且前五大样本权重合计不超过 60%。

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。