

上证大宗商品股票指数编制方案

上证大宗商品股票指数选取在上海证券交易所上市的规模较大、流动性较好的大宗商品生产类上市公司证券作为指数样本，采用等权重加权方式，以反映沪市大宗商品类证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证大宗商品股票指数
指数简称：上证商品
英文名称：SSE Commodity Equity Index
英文简称：SSE Commodity Equity
指数代码：000066

二、指数基日和基点

该指数以2003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

上证全指指数样本

2、选样方法

(1) 将样本空间中属于下列行业的证券列为大宗商品上市公司证券：

- 能源类：综合性石油与天然气企业、石油与天然气的勘探与生产、石油与天然气的炼制和营销、煤炭；
- 工业材料类：化学原料、铝、铜、黄金及其它贵金属、稀有金属、其它

有色金属及合金;

➤ 农业类: 化肥与农药、畜牧产品、其它农产品;

(2) 将待选样本分别按照过去一年日均总市值与日均成交金额由高到低排名, 将两指标的排名结果相加, 所得和的排名作为样本的综合排名。选取综合排名前 50 名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。