

中证煤炭指数编制方案

中证煤炭指数从沪深市场选取涉及煤炭开采、煤炭加工等业务的上市公司证券作为指数样本，以反映煤炭类相关上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证煤炭指数

指数简称：中证煤炭

英文名称：CSI Coal & Consumable Fuels Index

英文简称：CSI Coal

指数代码：399998

二、指数基日和基点

该指数以 2008 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) 将样本空间中属于煤炭行业的证券纳入煤炭主题；

(2) 如果 (1) 中证券数量少于或等于 50 只，则全部证券作为指数样本；
如果 (1) 中证券数量多于 50 只，则分别按照证券过去一年的日均成交金额、日均总市值由高到低排名，剔除成交金额排名后 10%、以及累积总市值占比达到 98%

以后的证券，并且保持剔除后证券数量不少于 50 只，将剩余全部证券作为指数样本。

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。