

国证能源金属指数编制方案

为反映沪深北交易所能源金属领域相关上市公司的证券价格变化情况,丰富指数化投资工具,编制国证能源金属指数。

一、代码与名称

指数名称: 国证能源金属指数

指数简称: 能源金属

英文名称: CNI Energy Metals Index

英文简称: Energy Metals

指数代码: 399366

二、基日与基点

指数的基日为 2004 年 12 月 31 日,基点为 1000 点。

三、选样空间

满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证:

1. 非 ST、*ST 证券;
2. 科创板证券、北交所证券上市时间超过一年; 其他证

- 券上市时间超过 6 个月；
3. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
 4. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
 5. 考察期内证券价格无异常波动；
 6. 公司业务范畴属于能源金属开采、加工、贸易和回收，包括但不限于锂、钴、镍、稀土等。

四、选样方法

首先，计算入围选样空间证券在最近半年的日均成交金额和日均总市值；

其次，剔除选样空间内最近半年的日均成交金额排名位于后 10% 的证券；

然后，对选样空间剩余证券按照最近半年的日均总市值从高到低排序，选取前 50 名证券作为指数样本，样本数量不足时按实际数量纳入。

五、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重

调整因子见“七、样本权重调整”。

六、样本调整

1. 样本定期调整

指数样本实施半年定期调整，于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本调整方案通常在实施前两周公布。

每次样本调整数量不超过样本总数的10%。排名在样本数70%范围内的非原样本按顺序入选，排名在样本数130%范围内的原样本按顺序优先保留。

在确定新入选样本后，在剩余证券中按选样指标从高到低排序选取样本数量5%的证券作为备选样本。

2. 样本临时调整

样本出现终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

样本公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同国证1000指数。

七、样本权重调整

在指数计算中，设置权重调整因子，使单只样本在每次定

期调整时的权重不超过 15%，前五大权重样本合计权重不超过 60%。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除证券在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进样本的权重调整因子。