

国证有色金属行业指数编制方案

为反映沪深北交易所有色金属行业上市公司的整体表现，向投资者提供更丰富的指数化投资标的，编制国证有色金属行业主题指数。

一、代码与名称

指数名称：国证有色金属行业指数

指数简称：国证有色

英文名称：CNI Non-Ferrous Metal Index

英文简称：CNI Non-Ferrous

指数代码：399395

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 1 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. 公司国证行业分类属于有色金属行业。

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总市值和日均成交金额；

其次，对入围证券在最近半年的日均成交金额按从高到低排序，剔除排名后 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 只作为指数样本，数量不足则按实际数量选入。

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：

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

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、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。

每次样本调整不设缓冲区，调整数量不设限制。

在确定新入选样本后，在剩余证券中按日均总市值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样本补足。

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样本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。