

深证大宗商品生产商指数编制方案

为反映深圳证券市场中大宗商品生产相关领域上市公司的总体证券价格变动趋势，编制深证大宗商品生产商指数。

一、代码与名称

指数名称：深证大宗商品生产商指数

指数简称：深证大宗

英文名称：SZSE Commodities Producer Index

英文简称：SZSE Commodity Producer

指数代码：399639

二、基日与基点

指数基日为 2004 年 12 月 31 日，基点为 1000。

三、选样空间

在深圳证券交易所上市交易且满足下列条件的所有 A 股：

1. 非 ST、*ST 的证券；
2. 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. 业务领域为以下几个方面的上市公司：

（1）能源：综合性石油天然气企业、石油天然气的勘探与生产、石油天然气炼制和销售、煤炭；

（2）原材料：化学制品、农用化工、有色金属、贵金属、钢铁；

（3）农业：林业产品、纸制品。

四、选样方法

首先，计算入围选样空间证券在最近半年的 A 股日均总市值和 A 股日均成交金额；

其次，对入围证券在最近半年的 A 股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 A 股日均总市值从高到低排序，选取前 40 名证券构成初始样本。

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：

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

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则。

六、样本调整

1. 样本定期调整

指数样本实施半年度定期调整，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，同深证成指。