

中证畜牧养殖指数编制方案

中证畜牧养殖指数从沪深 A 股中选取涉及畜禽饲料、畜禽药物以及畜禽养殖等业务的上市公司股票作为样本股，以反映畜牧养殖相关上市公司股票的整体表现。

一、 指数名称及代码

指数名称：中证畜牧养殖指数

指数简称：中证畜牧

英文名称：CSI Livestock Breeding Index

英文简称：CSI Livestock Breeding

指数代码：930707

二、 指数基日与基点

该指数以 2011 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

中证全指指数样本股

2、 选样方法

(1) 对样本空间内的股票按照最近一年的 A 股日均成交金额由高到低进行排名，剔除排名后 20% 的股票；

(2) 在剩余样本中，选取涉及畜禽饲料、畜禽药物以及畜禽养殖等业务的

上市公司股票作为待选样本;

(3) 在上述待选样本中, 按照过去一年日均总市值由高到低排名, 选取排名前 50 名的股票构成指数样本股, 不足 50 只时全部纳入。

四、 指数计算

中证畜牧养殖指数计算公式为:

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本股的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中, 调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$, 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, 以使单个样本股权重不超过 10%。

五、 指数样本和权重调整

1、 定期调整

中证畜牧养殖指数的样本股每半年调整一次, 样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整, 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。当样本股暂停上市或退市时, 将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆等情形的处理, 参照计算与维护细则处理。