

新华资源保障指数编制方案

(2021 年 8 月)

新华资源保障指数从沪深 A 股市场中,选取符合能源替代、矿业替代和智慧矿山三大领域标准的股票,以反映符合资源进口替代的上市公司的整体表现。

一、 指数名称和代码

指数名称: 新华资源保障指数

指数简称: 新华资源保障

英文名称: Xinhua Resource Security Index

英文简称: XH·Resource Security

指数代码: 989005

二、 指数基日和基点

该指数以 2019 年 6 月 14 日为基日,以 1000 点为基点。

三、 样本选取方法

1. 样本空间

在沪深A股市场上市，选取满足以下条件的股票组成样本空间：

- 1) 上市公司主营业务覆盖以下范围：包括但不限于能源进口替代（油气资源、煤炭资源、煤化工、光伏、风能）、非煤矿产进口替代（铁矿、铜矿、铝土矿、再生资源）、智慧矿山（智慧勘探、智慧采掘、智慧运输、智慧辅助技术）。
- 2) 上市时间超过三个月；
- 3) 流通市值不低于 20 亿元；
- 4) 非 ST、*ST 股票；
- 5) 公司近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
- 6) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
- 7) 考察期内股价无异常波动；
- 8) 非长期停牌股票；

2. 选样方法

1) 对样本空间内股票按照最近半年的 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) 对能源进口替代、非煤矿产进口替代、智慧矿山三大主题领域下多维度分别进行业务相关性水平测算。

3) 不同领域维度下有重复项的公司，保留最高分。

4) 选取业务相关性水平大于等于 40% 的股票构成指数样本股。针对智慧矿山主题，考虑主题方向上未来成长性适当放宽相关性要求。指数不超过 80 只样本股，如超过则优先选择过去一年日均自由流动市值居前的股票。

四、 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 =

$$\text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum \text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子}}{\sum \text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子}}$$

权重调整因子按自由流通市值进行加权，其中个股权重不超过 5%，单一主题领域维度权重不超过 20%，详见“五、指数样本和权重调整”。

五、 指数样本和权重调整

1. 定期调整

该指数每半年进行样本调整，调整生效日期为每年 6 月和 12 月的第二个星期五后的下一个交易日。每次调整的样本比例一般不超过 30%，除非因不满足样本空间条件被剔除的原样本超过了 30%。

样本设置缓冲区，排名在 60 名内的新样本优先进入指数，排名在 100 名之前的老样本优先保留。

2. 临时调整

特殊情况下将对指数样本进行调整。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、停牌等情形的处理，参照相关方法进行处理。

当出现样本股临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，新进指数的股票一般情况下将继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的收盘权重，并据此计算新进股票的权重因子。

六、 免责声明

新华资源保障指数属于新华指数（北京）有限公司所有，未经书面许可，任何单位和个人不得跟踪、交易该指数，或以指数为评价基准。对任何直接或间接使用本文件及任何信息而造成的损失，包括但不限于因内容不准确、不完整而导致的损失，新华指数（北京）有限公司及其关联方无须承担任何法律责任。