

附件:

## 中证商品期货指数系列 2023 年度定期调整信息

表 1: 各成份样本权重调整情况

商品	2022 年权重	2023 年权重
中质含硫原油	9.4892%	11.3213%
螺纹钢	9.1624%	9.3085%
铁矿石	8.9144%	8.7374%
阴极铜	7.4965%	8.1912%
黄金	8.6044%	7.8308%
白银	6.4116%	6.4317%
热轧卷板	5.1855%	5.8362%
豆粕	4.7633%	4.7379%
铝	4.1674%	4.6103%
豆油	4.1150%	4.4251%
精对苯二甲酸	3.6927%	4.3549%
棕榈油	3.7184%	3.9915%
镍	4.5736%	3.7279%
棉花	2.9213%	3.2201%
天然橡胶	3.2732%	3.1969%
甲醇	2.7761%	3.1595%
纯碱	——	2.6097%
白糖	2.1905%	2.2752%
锌	2.0844%	2.0337%
焦炭	6.4600%	——

表 2: 各板块权重调整情况

板块	2022 年权重	2023 年权重
贵金属类	15.0160%	14.2625%
黑色类	29.7223%	23.8821%
能源化工类	19.2312%	24.6423%
农产品类	17.7085%	18.6498%
有色金属类	18.3219%	18.5631%

表 3：2023-2024 年度成份合约对照表

品种	2023 年						2024 年					
	七月	八月	九月	十月	十一月	十二月	一月	二月	三月	四月	五月	六月
棕榈油	9月	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月
甲醇	9月	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月
白糖	9月	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月
铝	9月	10月	11月	12月	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月
锌	9月	10月	11月	12月	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月
棉花	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月	9月
天然橡胶	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月	9月
PTA	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月	9月
豆油	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月	9月
白银	12月	12月	12月	12月	6月	6月	6月	6月	6月	6月	12月	12月
镍	9月	10月	11月	12月	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月
豆粕	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月	9月
铁矿石	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月	9月
螺纹钢	10月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	10月	10月	10月	10月
铜	9月	10月	11月	12月	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月
黄金	12月	12月	12月	12月	2月	2月	4月	4月	6月	6月	8月	8月
原油	9月	10月	11月	12月	1月	2月	4月	4月	5月	6月	7月	8月
热轧卷板	10月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	10月	10月	10月	10月
纯碱	1月	1月	1月	1月	5月	5月	5月	5月	9月	9月	9月	9月

表 4：品种分类表

商品类别	商品
能源化工类	原油、燃料油（燃料油、低硫燃料油）、液化石油气、石油沥青、精对苯二甲酸、聚乙烯、聚丙烯、乙二醇、聚氯乙烯、苯乙烯、短纤、动力煤、甲醇、尿素、纯碱、玻璃、天然橡胶（天然橡胶、20号胶）
有色金属类	铜（阴极铜、国际铜）、铝、锌、铅、锡、镍、工业硅
黑色类	铁矿石、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、焦煤、焦炭、硅铁、锰硅
农产品类	小麦（普麦、硬麦 <sup>1</sup> 、强麦）、稻谷（早籼稻、晚籼稻、粳稻）、粳米、玉米、玉米淀粉、黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油、油菜籽、菜籽粕、菜油、棕榈油、棉花、棉纱、苹果、红枣、白糖、花生
林产品类	纸浆、人造板（胶合板、纤维板）
畜产品类	鸡蛋、生猪
贵金属类	黄金、白银

表 5：消费量数据来源

序号	商品	消费量口径	基础数据来源
----	----	-------	--------

<sup>1</sup> 硬麦期货在郑州商品交易所上市，最后一个合约是2012年11月到期。

1	原油	表观消费量	中国化工经济技术发展中心
2	甲醇	表观消费量	中国化工经济技术发展中心
3	聚丙烯	表观消费量	中国化工经济技术发展中心
4	聚乙烯	表观消费量	中国化工经济技术发展中心
5	精对苯二甲酸	表观消费量	中国化工经济技术发展中心
6	铜	消费量	安泰科
7	锌	消费量	安泰科
8	铝	消费量	安泰科
9	镍	消费量	安泰科
10	铁矿石	消费量*	国家统计局
11	螺纹钢	表观消费量	国家统计局、海关总署
12	豆粕	消费量	国家粮油信息中心
13	黄大豆 1 号	消费量	国家粮油信息中心
14	豆油	消费量	国家粮油信息中心
15	棕榈油	消费量	国家粮油信息中心
16	天然橡胶	表观消费量	中国橡胶信息贸易网、海关总署
17	白糖	表观消费量	中国糖业协会、海关总署
18	棉花	表观消费量	国家统计局、海关总署
19	纯碱	表观消费量	国家统计局、海关总署

\* 铁矿石的消费量采用国内生铁产量推算。