

2月10日，中金
公司与中证商品指数有限责任公
司联合发布“**中证中金公司商品期货综合指数**
”，指数简称“**中证中金商品指数**”。

大宗商品关乎国计民生，在国民经济发展中具有基础性作用。我国作为大宗商品重要的生产国和消费国，保障大宗商品的价格稳定和供应链安全具有高度重要性。为响应国家战略，服务实体经济，中金公司与中证商品指数公司联合发布“中证中金公司商品期货综合指数”，旨在能够全面、真实和客观地反映我国商品市场和宏观经济的运行情况，致力于成为大宗商品市场有代表性的领先性经济指标之一。

中证中金商品指数成份涵盖贵金属、能源化工、工业金属、农产品等四大类中流动性相对较好、国内消费额较大的20个期货品种

。该指数根据各品种的现货消费额确定品种权重，且兼顾相应的商品期货品种的流动性，从而使该指数能够更好地体现国内大宗商品市场及宏观经济走势，并具有编制方案透明度高、追踪误差低、可交易性强、以及指数成份流动性佳等特点。

该指数行情信息在中证商品指数公司官方网站以及万得资讯、东方财富、新华财经客户端等金融资讯平台

同步发布（指数代码“900001

”）。中证中金商品指数起始日为2015/06/30，根据历史回测数据显示，自指数起始日至2023/02/07，该指数年化收益率为16.43%，年化波动率为17.64%，夏普比率为0.93，最大回撤为24.64%。

该指数为中金公司与中证商品指数公司合作发布，中证商品指数公司是国内四家期货交易所出资设立的指数编制管理服务平台，承担着整合承接期货指数业务和资源、高质量丰富期货指数产品供给以及服务国家宏观经济决策和实体企业风险管理的重要使命。

中金公司致力于为企业和机构投资者提供多元化的资产配置方案。展望未来，中金公司计划进一步丰富挂钩包含“中证中金公司商品期货综合指数”在内指数的场外衍生品及收益凭证等产品，以数字赋能金融，在指数策略业务方向上开拓深耕，为客户提供多元化、创新的金融产品与专业服务，助力国家金融市场发展。

注：指数年化收益率=（期末指数点位/期初指数点位）^{365/（期末-期初之间自然日}

数目)) -1 ; 指数年化波动率=指数每日涨跌幅的标准差* (252) ^0.5 ; 指数夏普比率=年化收益率/年化波动率 ; 指数最大回撤= $\max_{i,j} ((D_i - D_j) / D_i)$, 其中 D_i 为第 i 天的指数点位, D_j 为 D_i 后面某一天的指数点位。

*特别提示：本页面所列历史数据均不能预示指数未来表现，不构成投资建议亦不构成任何承诺或保证。

本页面所含信息仅供参考，不构成交易任何金融产品或参与任何特定交易策略的投资建议或要约、要约邀请，不构成任何合同或承诺或者达成任何交易的基础，不构成对任何金融产品报价和交易情况的研究分析或咨询意见，亦不构成对任何金融产品交易市场变动情况的预测。中金公司对信息内容是否适用于所有投资者及其具体投资目标和财务状况不作任何法律性声明及保证，亦不承担使用上述信息所造成的任何直接或间接的损失或损害赔偿。