

中证绿色价值 ESG 100 指数编制方案

中证绿色价值 ESG 100 指数从沪深 300 指数样本中，基于中央财经大学绿色金融国际研究院提供的上市公司环境保护、社会责任、公司治理表现计算的 ESG 评分，选取评分最高的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映沪深 300 样本中 ESG 评分较高的上市公司的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证绿色价值 ESG 100 指数

指数简称：绿色价值 100

英文名称：CSI Green Value ESG 100 Index

英文简称：Green Value 100

指数代码：931168

二、指数基日和基点

该指数以 2016 年 6 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

沪深 300 指数样本

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券，基于上市公司的环境保护、社会责任、公司治理等方面表现计算 ESG 评分并降序排名；

其中，环境保护、社会责任、公司治理计算的 ESG 评分由中央财经大学绿色金融国际研究院提供；环境保护评分在 ESG 评分的权重为 60%，社会责任、公司治理评分权重分别占 ESG 评分的 15%和 25%。

(2) 按照沪深 300 指数样本在中证二级行业的样本数量分布，确定各二级行业的样本分配只数。具体方法是：

第 i 行业样本分配只数 = 样本空间内第 i 行业所有待选证券数量/300 × 100；

(3) 按照行业的样本分配只数，在行业内选取 ESG 评分排名靠前的证券作为指数样本；

(4) 对各行业选取的样本进一步调整，使样本总数为 100 只。

四、指数计算

指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = Σ (证券价格 × 调整股本数 × 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，以使单个样本权重不超过 5%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 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。当样本退市时,将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理,参照计算与维护细则处理。