

中证绿色电力指数编制方案

中证绿色电力指数选取业务涉及光伏发电、风电、水电等绿色电力领域的 50 只上市公司证券作为指数样本，以反映绿色电力领域上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证绿色电力指数

指数简称：绿色电力

英文名称：CSI Green Electricity Index

英文简称：Green Electricity

指数代码：931897

二、指数基日和基点

该指数以 2017 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

同中证全指指数的样本空间

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取光伏发电、风电、水电等绿色电力领域的上市公司证券作为待选样本。

具体做法为，将光伏发电、风电、水电四级行业的全部上市公司证券，以及火电、核电四级行业上市公司中业务涉及光伏发电、风电、水电等绿色电力领域的全部上市公司证券作为待选样本。

(2) 将待选样本按照过去一年日均总市值由高到低排名，在待选样本中选取排名前 50 名的证券作为指数样本。

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 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使光伏发电、风电、水电，以及火电、核电领域绿色电力业务占比超过 10% 的上市公司证券权重不超过 10%，其他上市公司证券权重不超过 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。