

中证国新央企现代能源指数编制方案

中证国新央企现代能源指数由国新投资有限公司定制，主要选取国务院国资委下属业务涉及绿色能源、化石能源、能源输配等现代能源产业的 50 只上市公司证券作为指数样本，以反映央企现代能源主题上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证国新央企现代能源指数

指数简称：央企现代能源

英文名称：CSI Guoxin Central-SOEs Modern Energy Index

英文简称：Central-SOEs Modern Energy

指数代码：932037

二、指数基日和基点

该指数以 2016 年 12 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，选取属于国资委央企

名录，以及实际控制权或第一大股东归属于国务院国资委的上市公司证券；

(2) 对上述待选样本，选取业务涉及绿色能源产业、化石能源产业和能源输配产业的上市公司证券作为现代能源主题证券：

- 绿色能源产业：风电、光伏、水电、核电、新能源金属材料以及相关专业服务等等；
- 化石能源产业：煤炭、石油与天然气、化石能源电力、化石能源机械、化石能源基建业务、化石能源专业服务等等；
- 能源输配产业：输变电设备、电网及自动化、输配电基础设施及相关配套技术等等；

(3) 根据市值和中证碳中和评价，在上述现代能源主题证券中合计选取 50 只证券作为指数样本：

对绿色能源产业和能源输配产业，按照过去一年日均总市值由高到低排名，分别选取 20 只和 10 只证券作为指数样本；对化石能源产业，分别计算其在各领域的过去一年日均总市值排名和中证碳中和评价排名，并以两者的算术平均计算综合排名，选取综合排名靠前的 20 只证券作为指数样本。

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，以使化石能源产业中绿色收入占比不高于 5% 的上市公司证券权重不超过 3%，绿色收入占比高于 5% 但不高于 10% 的上市公司证券权重不超过 5%；其他上市公司证券

权重不超过 10%；非国务院国资委或国资委下属中央企业实际控制的上市公司证券权重不超过 3%。

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。