

中证绿色投资股票指数编制方案

中证绿色投资股票指数选取绿色收入占比较高,且无显著环境风险的代表性沪深 A 股作为样本股,反映绿色投资主题公司的整体表现。

一、 指数名称与代码

指数名称: 中证绿色投资股票指数
指数简称: 绿色投资
英文名称: CSI Green Investing Index
英文简称: Green Investing
指数代码: 930956

二、 指数基日与基点

指数以 2012 年 6 月 29 日为基日,以该日收盘后所有样本股的调整市值为基期,以 1000 点为基点。

三、 样本选取方法

1. 样本空间

以中证全指作为样本空间。

2. 选样方法

首先,将样本空间中过去一年日均成交金额排名在后 20%的股票剔除;

其次,根据上市公司的绿色收入和环境风险信息,选定绿色收入占比较高,且无显著环境风险的公司作为绿色投资主题待选样本;

最后,按照过去一年 A 股日均总市值由高到低排名,选取排名前 300 的股票构成中证绿色投资股票指数样本股。

四、 指数计算

中证绿色投资股票指数采用自由流通市值加权方式计算，计算公式为：

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

其中：调整市值 = $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ ，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，以使样本股权重不超过 5%。

五、 指数样本和权重调整

1、 定期调整

中证绿色投资股票指数样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五收盘后的下一交易日。

权重因子随样本股定期调整而调整，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样本进行临时调整。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。