

中国低碳指数编制方案

中国低碳指数选取境内外上市的中国公司中在低碳经济领域具有代表性的 40 家公司股票作为样本股，反映低碳公司的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中国低碳指数

指数简称：中国低碳

英文名称：China Low Carbon Index

英文简称：CSI Security and protection

指数代码：H11113

二、指数基日和基点

该指数以 2006 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

符合下列三个条件之一、在中国及中国以外地区上市交易且上市交易时间超过 3 个月的股票构成样本空间：

- a) 注册地在中国大陆；
- b) 公司营运中心在中国大陆；
- c) 公司主营业务收入 50% 以上来自中国大陆。

2、选样方法

- (1) 对样本空间内股票按照最近一年（新股为上市以来）的 A 股日均成交

金额由高到低进行排名，剔除排名后 20%的股票；剔除最近一年日均总市值低于 20 亿元人民币的股票；

(2) 对样本空间的剩余股票，将最近一个会计年度在以下业务的收入占比达到 50%（或 35 亿人民币）的公司股票纳入低碳经济主题：

清洁能源发电（太阳能、风能、核能、水电、清洁煤等）、能源转换及存储（智能电网、电池等）、清洁生产及消费（能源效率等）、废物处理（水处理和垃圾处理）；

(3) 在待选样本中，对低碳经济主题股票在盈利性、资本扩张、增长潜力、技术创新等方面进行综合评价，根据评价结果选取排名靠前的 40 只公司股票构成指数样本股。

四、 指数计算

中国低碳指数计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\Sigma(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使相应主题样本股的合计权重为主题样本数 $\times 2.5\%$ ，而单个样本股权重不超过 5%。

五、 指数样本和权重调整

1、 定期调整

中国低碳指数的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。

当出现样本股临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，新进指数的股票一般情况下将继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的收盘权重，并据此计算新进股票的权重因子。