

## 中证中国蓝天环境改善主题指数编制方案

中证中国蓝天环境改善主题指数从蓝天环境改善主题投资的角度反映了在沪深港三地上市证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证中国蓝天环境改善主题指数

指数简称：蓝天环境改善

英文名称：CSI China Blue Sky Environment Improvement Thematic Index

英文简称：CN Blue Sky Improve

指数代码：931123（人民币）/931124（港元）/931125（美元）/931126（欧元）

### 二、指数基日和基点

该指数以 2016 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

中证中国蓝天环境改善主题指数的样本空间由满足以下条件的证券构成：

- （1）中证全指指数样本股；
- （2）中证港股通综合指数样本股。

#### 2、选样方法

（1）对中证全指样本股，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排名，剔除排名后 20% 的股票；对中证港股通综合指数样本股，剔除最近一年日均成交金额小于 500 万港元的股票。

(2) 对样本空间的剩余股票，选取符合蓝天环境改善主题的股票作为成分股空间。蓝天环境改善主题指符合下列行业定义：

一级代码	一级行业名称（环保策略）	二级代码	二级行业名称（环保技术）
CLE	清洁能源	RO	可再生资源运营商
CLE	清洁能源	SO	太阳能技术
CLE	清洁能源	WTG	风能技术
CLE	清洁能源	NG	天然气
CWA	清洁能源和水	WI	水基础设施
CWA	清洁能源和水	MFC	水计量和流量控制
CWA	清洁能源和水	APCT	空气污染控制技术
ERA	环境资源	WM	废弃物管理
ERA	环境资源	RR	回收和再利用
ERA	环境资源	CO2	二氧化碳生成与交易
ERA	环境资源	FOR	可持续林业
EE	能源效率	EEL	能效基础设施
EE	能源效率	EERM	能效促进材料
EE	能源效率	SMA	智能计量基础设施
EE	能源效率	LED	LED 技术
CLT	清洁交通	CLT	清洁交通技术
CLT	清洁交通	CBA	清洁电池
CLT	清洁交通	TRA	交通基础设施
CLT	清洁交通	RAI	铁路运营商

(3) 对成分股空间股票，计算三个环境改善指标：

- a) 计算公司对环境改善行为收入占比；
- b) 计算公司对环境有害行为的收入占比；
- c) 针对有潜在公司治理问题的公司，标注公司治理行为指标。

在确定上述三个环境改善指标后，按照下列标准对于成分股空间进行剔除：

- 条件 1) 剔除环境改善行为收入低于 20% 的公司；
- 条件 2) 剔除对环境有害行为的收入大于 50% 的公司；
- 条件 3) 剔除有公司治理问题标注的公司。

经过上述剔除后，成分股空间剩余股票作为指数样本股。

#### 四、指数计算

中证中国蓝天环境改善主题指数计算公式为：

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

其中，调整市值 =  $\sum(\text{股价} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{汇率})$ 。汇率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，以使指数样本股权重不超过 5%，同时同一环保技术行业内的股票权重不超过 40%。

## 五、 指数样本和权重调整

### 1、 定期调整

中证中国蓝天环境改善主题指数的样本股每年调整两次，样本股调整实施时间是每年 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、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当港股通范围发生变动导致样本股不再满足港股通资格时，将进行相应调整。