

中证可持续发展 100 指数编制方案

中证可持续发展 100 指数基于可持续发展评估模型,从沪深 300 样本空间中选取可持续发展评分最高的 100 家上市公司股票作为样本股,反映符合可持续发展投资理念的 A 股上市公司的整体表现。

一、 指数名称和代码

指数名称: 中证可持续发展 100 指数

指数简称: 持续发展

英文名称: CSI Sustainable Development 100 Index

英文简称: Sustainable Development

指数代码: 931268

二、 指数基日和基点

该指数以 2014 年 06 月 30 日为基日,以 1000 点为基点。

三、 样本选取方法

1、 样本空间

沪深 300 指数样本股

2、 选样方法

(1) 对样本空间内股票从产业政策、特殊行业、财务问题、负面事件、违法违规以及特殊处理等六个方面剔除不符合资质的股票;

(2) 对样本空间内剩余股票从企业目标(包括价值驱动、战略驱动、业务驱动)、企业创新(包括技术创新、模式创新、管理创新)和企业效益(包括经

济贡献、社会贡献、环境贡献)三个维度进行可持续发展评估,并选取评分最高的100只股票作为指数样本股。

四、 指数计算

中证可持续发展100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 = Σ (股价 \times 调整股本数 \times 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,以使单个样本股权重不超过10%。

五、 指数样本和权重调整

1、 定期调整

中证可持续发展100指数的样本股每半年调整一次,样本股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。