

中证嘉实沪深 300ESG 领先指数编制方案

中证嘉实沪深 300ESG 领先指数从沪深 300 样本股中，选取 ESG 评分较好的 100 只股票作为样本，以反映沪深 300 中环境保护、社会责任、公司治理综合表现较好的公司股票的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证嘉实沪深 300ESG 领先指数

指数简称：嘉实 ESG

英文名称：CSI 300 Harvest ESG Leaders Index

英文简称：CSI 300 Harvest ESG

指数代码：931382

二、指数基日和基点

该指数以 2015 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

沪深 300 指数样本股

2、选样方法

(1) 剔除样本空间中有重大治理问题、债务违约、环境处罚的股票；

(2)根据环境保护、社会责任、公司治理计算股票的 ESG 评分并降序排名;

(3) 按照沪深 300 指数样本股中证一级行业样本数量, 分配各行业样本配额, 具体方法是:

第 i 行业样本配额=样本空间内第 i 行业所有股票数量/300×100

再对各行业样本配额作进一步调整, 使配额均为整数, 且总数为 100;

(4) 按照行业样本配额, 在行业内选取 ESG 评分排名靠前的股票。

四、指数计算

中证嘉实沪深 300ESG 领先指数的计算公式为:

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

其中, 调整市值 = Σ (股价 × 调整股本数 × 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, 以使该指数中证一级行业权重分布与沪深 300 指数相同; 在行业内采用自由流通市值加权, 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

中证嘉实沪深 300ESG 领先指数每半年调整一次样本股, 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。