

中证中财-苏农长三角 ESG 债券指数编制方案

中证中财-苏农长三角 ESG 债券指数从主体评级 AA+及以上且注册地位于长三角城市群的信用债发行人中，选取中央财经大学绿色金融国际研究院 ESG 分数较高的 100 名发行人所发行的债券作为指数样本，以反映长三角地区 ESG 分数较高的发行人所发行债券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证中财-苏农长三角 ESG 债券指数

指数简称：中证中财-苏农长三角 ESG 债券

英文名称：CSI CUFESZRCB Yangtze River Delta ESG Bond Index

英文简称：CSI CUFESZRCB Yangtze River Delta ESG Bond

指数代码：931490

二、指数基日和基点

该指数以 2018 年 6 月 30 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

中证中财-苏农长三角 ESG 债券指数的样本空间由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在沪深交易所或银行间市场上上市的企业债、公司债、中期票据等债券，不包括私募品种，债券币种为人民币；

(2) 主体评级: AA+及以上;

(3) 剩余期限: 1 年以上;

(4) 发行人所在地: 长三角城市群, 包括上海市、南京市、无锡市、常州市、苏州市、南通市、盐城市、扬州市、镇江市、泰州市、杭州市、宁波市、嘉兴市、湖州市、绍兴市、金华市、舟山市、台州市、合肥市、芜湖市、马鞍山市、铜陵市、安庆市、滁州市、池州市、宣城市等;

(5) 付息方式: 固定利率付息或一次还本付息。

2、选样方法

(1) 计算样本空间内主体评级 AAA 和主体评级 AA+的发行人数量占比, 确定各信用级别发行人数量, 以使得发行人总数为 100;

(2) 对上述两类信用级别的发行人, 按照中央财经大学绿色金融国际研究院 ESG 分数由高到低排名, 同时根据 (1) 中所确定的发行人数量, 依次选取排名靠前的发行人, 并以样本空间中上述发行人所发行的债券作为指数样本。

四、指数计算

中证中财-苏农长三角 ESG 债券指数采用派许加权综合价格指数方法计算, 计算公式为:

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本债券总市值} + \text{报告期债券派息}}{\text{除数}} \times 100$$

其中, 报告期样本债券总市值=Σ (全价×发行量×权重因子), 全价=净价+应计利息。权重因子介于 0 和 1 之间, 以使单一发行人权重不超过 5%。

该指数计算用价格为中证估值价格, 其他计算用基础数据、除数调整参见计算与维护细则。

五、样本调整

1、定期调整

中证中财-苏农长三角 ESG 债券指数样本每月调整一次，定期调整生效日为每月首个交易日，定期调整数据提取日为生效日前第二个交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，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。

发行人每年调整一次，定期调整生效日为每年 7 月的首个交易日。

2、临时调整

若样本发生摘牌等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；样本发生其他事件，参照计算与维护细则处理。