

中证中财-苏农苏州绿色发展指数编制方案

中证中财-苏农苏州绿色发展指数从沪深两市注册地为苏州市的上市公司中，选取中央财经大学绿色金融国际研究院 ESG 分数最高的 50 只上市公司证券作为指数样本，以反映苏州 ESG 分数高的上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证中财-苏农苏州绿色发展指数

指数简称：苏州绿色发展

英文名称：CSI CUFESZRCB Suzhou Green Development Index

英文简称：Suzhou Green Development

指数代码：931478

二、指数基日和基点

该指数以 2017 年 6 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

中证全指指数样本

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除

排名后 20%的证券；

(2) 对样本空间内剩余证券，选取公司注册地为苏州的上市公司证券作为待选样本；

(3) 按照待选样本在中证一级行业的数量分布，确定各一级行业的样本数量，具体方法为：

$$\text{行业样本数量} = 50 / \text{待选样本数量} \times \text{行业中待选样本数量}$$

(4) 按照各一级行业的样本数量，在行业内选取中央财经大学绿色金融国际研究院 ESG 分数高的证券，构成 50 只指数样本。若样本数量不足或超过 50，做进一步调整以使最终样本数量为 50。

四、指数计算

中证中财-苏农苏州绿色发展指数的计算公式为：

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

其中，调整市值 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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，以使单个样本权重不超过 10%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

中证中财-苏农苏州绿色发展指数每半年调整一次样本，样本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。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。