

中证中银证券 300 ESG 指数编制方案

中证中银证券 300 ESG 指数以沪深 300 指数样本为基础，通过 ESG 得分对样本权重进行调整，在跟踪沪深 300 指数的同时，突出在环境保护、社会责任和公司治理三个维度表现优异的上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证中银证券 300 ESG 指数

指数简称：中银证券 300 ESG

英文名称：CSI BOC International 300 ESG Index

英文简称：BOC International 300 ESG

指数代码：931598

二、指数基日和基点

该指数以 2016 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

沪深 300 指数样本

2、选样方法

选取样本空间内的全部证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

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

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，以使样本按照 ESG 调整因子乘以自由流通市值加权，且单个样本与沪深 300 指数样本中对应证券的权重偏离不超过 3%。

$$\text{ESG 调整因子} = \begin{cases} 1 + ESG_{Z-score}, & ESG_{Z-score} > 0 \\ 1 \\ 1 - ESG_{Z-score}, & ESG_{Z-score} \leq 0 \end{cases}$$

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每半年调整一次，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。