

## 华证能效领先指数编制方案

### 一、指数名称和代码

指数名称：华证能效领先指数

指数简称：能效领先

英文名称：SSI Energy Efficient Leaders Index

英文简称：Energy Efficient Leaders

指数代码：997207

### 二、指数基日和基点

该指数以 2020 年 8 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

### 三、样本选取方法

#### 1. 样本空间

同华证全指指数样本空间中的沪深 A 股

#### 2. 可投资性筛选

(1) 对样本空间的 A 股，过去 1 年的日均成交金额位于其所在  
证券交易所全部上市证券的前 80%；

(2) 剔除 ESG 尾部风险类型为“警告”或“严重警告”的上市公司。

#### 3. 选样方法

(1) 在符合上述可投资性筛选条件的样本空间内，选择母公司或  
核心子公司名列工信部重点用能行业能效领跑者企业名单  
作为备选样本。

（2）在备选样本中，选取过去 3 个月日均总市值前 50 只股票作为最终样本，如数量不足则全部纳入。

#### 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 =  $\sum$ （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

指数样本每季度调整一次，调整实施时间为每年 3 月、6 月、9 月和 12 月的第 10 个交易日。每次调整的样本比例一般不超过 30%。

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样本进行调整。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、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。