

华证行业 ESG 领先基准指数编制方案

一、指数名称和代码

见附录

二、指数基日和基点

华证行业 ESG 基准指数以 2011 年 12 月 30 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) 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) 在样本空间中，按照如下规则选取上市公司作为备选样本：
 - a. 将样本空间按华证行业分类标准进行分类；
 - b. 选择行业内 ESG 得分处于前 50%的公司。
- (2) 选取行业内 E、S、G 至少两个指标得分处于前 50%的公司。

在待选样本中，由于不同行业选出股票数目存在较大差异，

所以按照指数发布日前的最新一期股票数量确定最终成分股数量：

- a. 如果该行业股票数量低于 15 只，指数暂不发布（附录表中成分股数量为 0）；
- b. 数量大于 15 小于 50，选前 30 只纳入（不足 30，全部纳入）；
- c. 数量大于等于 50 只小于 100 只，选前 50 只纳入；
- d. 数量大于等于 100 只小于 200 只，选前 100 只纳入；
- e. 数量大于等于 200 只，选前 200 只纳入。

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=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。

附录一

华证一级行业 ESG 指数名称和代码

指数代码	指数简称	一级行业指数名称	成分股数目
997513	主要消费 ESG 领先	华证主要消费行业 ESG 领先指数	100
997514	信息技术 ESG 领先	华证信息技术行业 ESG 领先指数	200
997515	公用事业 ESG 领先	华证公用事业行业 ESG 领先指数	50
997516	医药医疗 ESG 领先	华证医药医疗行业 ESG 领先指数	100
997517	原材料 ESG 领先	华证原材料行业 ESG 领先指数	200
997518	可选消费 ESG 领先	华证可选消费行业 ESG 领先指数	200
997519	工业 ESG 领先	华证工业行业 ESG 领先指数	200
997520	房地产 ESG 领先	华证房地产行业 ESG 领先指数	30
997521	能源 ESG 领先	华证能源行业 ESG 领先指数	30
997522	通信服务 ESG 领先	华证通信服务行业 ESG 领先指数	50
997523	金融 ESG 领先	华证金融行业 ESG 领先指数	50

附录二

华证二级行业 ESG 指数名称和代码

指数代码	指数简称	二级行业指数名称	成分股数目
997524	交通运输 ESG 领先	华证交通运输行业 ESG 领先指数	50
997525	化工 ESG 领先	华证化工行业 ESG 领先指数	100
997526	医疗 ESG 领先	华证医疗行业 ESG 领先指数	50
997527	医药 ESG 领先	华证医药行业 ESG 领先指数	100
997528	商业用品 ESG 领先	华证商业服务与用品 II 行业 ESG 领先指数	30
997529	家庭用品 ESG 领先	华证家庭与个人用品行业 ESG 领先指数	0
997530	市政设施 ESG 领先	华证市政设施行业 ESG 领先指数	30
997531	建筑装饰 ESG 领先	华证建筑装饰行业 ESG 领先指数	50
997532	有色金属 ESG 领先	华证有色金属采矿及制品行业 ESG 领先指数	50
997533	机械制造 ESG 领先	华证机械制造行业 ESG 领先指数	100
997534	汽车零件 ESG 领先	华证汽车与汽车零部件行业 ESG 领先指数	50
997535	消费者服务 ESG 领先	华证消费者服务行业 ESG 领先指数	30
997536	环保 ESG 领先	华证环保行业 ESG 领先指数	30
997537	电信服务 ESG 领先	华证电信服务行业 ESG 领先指数	0
997538	电力电网 ESG 领先	华证电力电网行业 ESG 领先指数	30
997539	电力设备 ESG 领先	华证电力设备行业 ESG 领先指数	100
997540	电子 ESG 领先	华证电子行业 ESG 领先指数	100
997541	纺织与珠宝 ESG 领先	华证纺织服装与珠宝行业 ESG 领先指数	30
997542	耐用消费品 ESG 领先	华证耐用消费品行业 ESG 领先指数	50
997543	航空与国防 ESG 领先	华证航空航天与国防行业 ESG 领先指数	30
997544	计算机 ESG 领先	华证计算机行业 ESG 领先指数	100
997545	通信设备 ESG 领先	华证通信设备及技术服务行业 ESG 领先指数	30
997546	通讯传媒 ESG 领先	华证通讯传媒行业 ESG 领先指数	30
997547	造纸与包装 ESG 领先	华证造纸与包装行业 ESG 领先指数	30
997548	钢铁 ESG 领先	华证钢铁行业 ESG 领先指数	30
997549	银行 ESG 领先	华证银行行业 ESG 领先指数	30
997550	零售业 ESG 领先	华证零售业行业 ESG 领先指数	30

编制方案（2024 年 V2）

997551	非金属材料 ESG 领先	华证非金属采矿及制品行业 ESG 领先指数	30
997552	非银金融 ESG 领先	华证非银金融行业 ESG 领先指数	30
997553	食品饮料 ESG 领先	华证食品、饮料与烟草行业 ESG 领先指数	50
997554	用品零售 ESG 领先	华证食品与主要用品零售 II 行业 ESG 领先指数	0