

华证行业 ESG 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 80%的公司。
- (2) 选取行业内 E、S、G 至少两个指标得分处于前 80%的公司。

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=∑（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。

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
999113	主要消费 ESG	华证主要消费行业 ESG 指数
999114	信息技术 ESG	华证信息技术行业 ESG 指数
999115	公用事业 ESG	华证公用事业行业 ESG 指数
999116	医药医疗 ESG	华证医药医疗行业 ESG 指数
999117	原材料 ESG	华证原材料行业 ESG 指数
999118	可选消费 ESG	华证可选消费行业 ESG 指数
999119	工业 ESG	华证工业行业 ESG 指数
999120	房地产 ESG	华证房地产行业 ESG 指数
999121	能源 ESG	华证能源行业 ESG 指数
999122	通信服务 ESG	华证通信服务行业 ESG 指数
999123	金融 ESG	华证金融行业 ESG 指数

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	一级行业指数名称
999124	交通运输 ESG	华证交通运输行业 ESG 指数
999125	化工 ESG	华证化工行业 ESG 指数
999126	医疗 ESG	华证医疗行业 ESG 指数
999127	医药 ESG	华证医药行业 ESG 指数
999128	商业服务与用品 ESG	华证商业服务与用品 II 行业 ESG 指数
999129	家庭与个人用品 ESG	华证家庭与个人用品行业 ESG 指数
999130	市政设施 ESG	华证市政设施行业 ESG 指数
999131	建筑装饰 ESG	华证建筑装饰行业 ESG 指数
999132	有色金属 ESG	华证有色金属采矿及制品行业 ESG 指数
999133	机械制造 ESG	华证机械制造行业 ESG 指数
999134	汽车及其零部件 ESG	华证汽车与汽车零部件行业 ESG 指数
999135	消费者服务 ESG	华证消费者服务行业 ESG 指数
999136	环保 ESG	华证环保行业 ESG 指数
999137	电信服务 ESG	华证电信服务行业 ESG 指数
999138	电力电网 ESG	华证电力电网行业 ESG 指数
999139	电力设备 ESG	华证电力设备行业 ESG 指数
999140	电子 ESG	华证电子行业 ESG 指数
999141	纺织服装与珠宝 ESG	华证纺织服装与珠宝行业 ESG 指数
999142	耐用消费品 ESG	华证耐用消费品行业 ESG 指数
999143	航空航天与国防 ESG	华证航空航天与国防行业 ESG 指数
999144	计算机 ESG	华证计算机行业 ESG 指数
999145	通信设备 ESG	华证通信设备及技术服务行业 ESG 指数
999146	通讯传媒 ESG	华证通讯传媒行业 ESG 指数
999147	造纸与包装 ESG	华证造纸与包装行业 ESG 指数
999148	钢铁 ESG	华证钢铁行业 ESG 指数
999149	银行 ESG	华证银行行业 ESG 指数
999150	零售业 ESG	华证零售业行业 ESG 指数
999151	非金属材料 ESG	华证非金属采矿及制品行业 ESG 指数
999152	非银金融 ESG	华证非银金融行业 ESG 指数
999153	食品饮料 ESG	华证食品、饮料与烟草行业 ESG 指数
999154	主要用品零售 ESG	华证食品与主要用品零售 II 行业 ESG 指数