

## 国证环保指数编制方案

为反映沪深北交易所环保产业相关的上市企业的市场表现，丰富指数化投资标的，编制国证环保指数。

### 一、代码与名称

指数名称：国证环保指数

指数简称：国证环保

英文名称：CNI EP Index

英文简称：CNI EP

指数代码：399358

### 二、基日与基点

指数的基日为 2002 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

### 三、选样空间

满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证：

1. 非 ST、\*ST 证券；

2. 科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年；其他证券上市超过 6 个月；
3. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
4. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
5. 与环保设备制造、环保服务（减排、控制大气污染、消除噪声、处理废弃物及处理废水等活动）和清洁生产技术及清洁产品（新能源、清洁能源和可再生能源、节能产品、绿色农业等）相关的上市公司（具体见附件《环保行业划分标准》）；
6. 公司治理指标评级标准达到 65 分并且社会公示后无异议。

#### 四、选样方法

首先，计算入围选样空间证券在最近半年的日均成交金额和日均总市值；

其次，剔除选样空间内最近半年日均成交金额排名后 10% 的证券；

然后，对选样空间剩余证券按照最近半年的日均总市值从高到低排序，选取前 40 名证券作为指数样本。

#### 五、指数计算

采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则。

## 六、样本调整

### 1. 样本定期调整

指数样本实施半年定期调整，于每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本调整方案通常在实施前两周公布。

每次样本调整数量不超过样本总数的 10%。排名在样本数 70% 范围内的非原样本按顺序入选，排名在样本数 130% 范围内的原样本按顺序优先保留。

在确定新入选样本后，在剩余证券中按选样指标从高到低排序选取样本数量 5% 的证券作为备选样本。

### 2. 样本临时调整

样本出现终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

样本公司被实施风险警示、发生收购、合并、分拆等情形的处理，同国证 1000 指数。

## 附件：环保行业划分标准

1. 环保设备：防大气污染设备、消除噪声设备、监测仪器设备、废水处理、废弃物管理和循环利用设备等；

2. 环保服务：控制大气污染、消除噪声、处理废弃物及处理废水等方面的活动，如：

- 脱硫、污水处理、垃圾发电等；

3. 清洁生产技术和清洁产品：清洁生产技术与设备，新能源、清洁能源和可再生能源的开发及节能技术、设备，生态标志食品和绿色食品等，如：

- 新能源和清洁能源：乙醇汽油、太阳能、风力发电、水力发电、甲醇汽油等
- 节能建材：节能型材、节能玻璃、保温材料等
- 节能产品：节能灯等
- 清洁产品：绿色农业、绿色食品、尾气净化剂等