

# 国证 ESG 300 指数编制方案

为反映沪深北交易所中 ESG 表现较好公司的市场表现，为投资者提供更丰富的指数化投资工具，编制国证 ESG 300 指数。

## 一、代码与名称

指数名称：国证 ESG 300 指数

指数简称：ESG 300

英文名称：CNI ESG 300 Index

英文简称：CNI ESG 300

指数代码：399378

## 二、基日与基点

指数的基日为 2010 年 6 月 30 日，基点为 1000 点。

## 三、选样空间

国证 ESG 300 指数以国证 1000 为样本空间。

## 四、选样方法

首先，剔除样本空间内 ESG 风险评估在前 10% 的证券；  
其次，在国证二级行业内，选取 ESG 评分在行业排名前 50% 的证券；  
最后，对选样空间剩余证券按照 ESG 评分由高到低排序，选取 300 只样本。

## 五、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

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

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本权重调整”。

## 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。

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 ESG 评分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、分拆情形的处理，同国证 1000 指数。

## 七、样本权重调整

在定期调整时，设置权重调整因子，使单只样本在每次定期调整时的权重不超过 10%。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除样本在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进样本的权重调整因子。