

# 国证绿色电力指数编制方案

为反映沪深北交易所绿色电力相关上市公司的整体表现，为投资者提供更丰富的指数化投资标的，编制国证绿色电力指数。

## 一、代码与名称

指数名称：国证绿色电力指数

指数简称：绿色电力

英文名称：CNI Green Electricity Index

英文简称：Green Electricity

指数代码：399438

## 二、基日与基点

指数基日为 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；其他证券上市时间超过 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. 考察期内证券价格无异常波动；
6. 公司业务领域属于清洁能源发电，包括但不限于水力发电、光伏发电、风力发电、核能发电等。

#### 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总市值和日均成交额；

其次，剔除选样空间内最近半年的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 50 名证券作为指数样本。

#### 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：

实时指数 = 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

指数样本实施半年度定期调整，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，在剩余证券中按照日均总市值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

在指数计算中，设置权重调整因子，根据样本公司的绿色

电力业务占比将样本分为两档,相应样本权重上限分别为 10%、3%。

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。