

## 指数介绍

中财-国证深港通绿色优选指数由深圳证券信息有限公司与中央财经大学绿色金融国际研究院联合发布，是市场上首只跨深港市场的绿色股票指数，旨在反映深港通机制内绿色概念股票的运行特征，提供跨境绿色投资的业绩基准和投资标的。

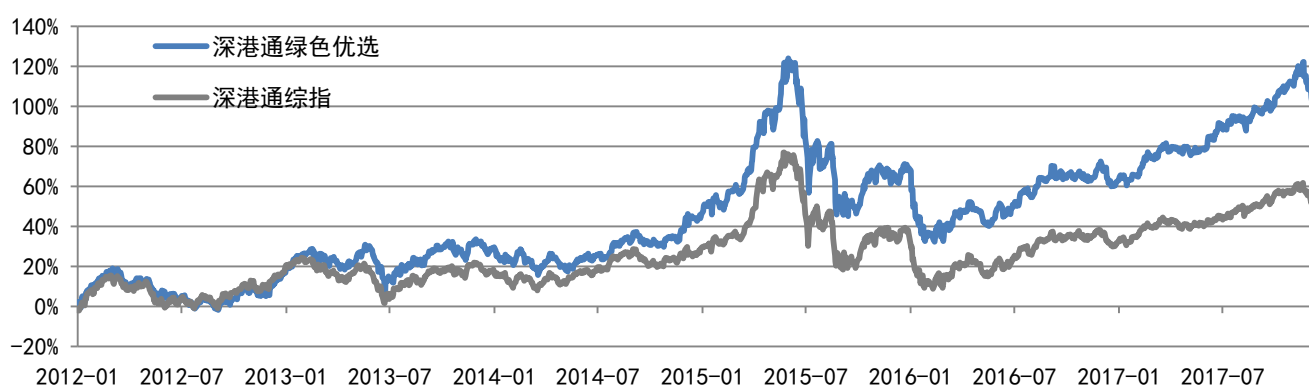
指数采用人民币和港币计价，由深圳证券信息有限公司计算和发布实时点位，通过国证指数网、信息商终端发布展示实时行情。

## 指数构建

中财-国证深港通绿色优选指数选样范围覆盖所有深港通标的股票，在参考证监会行业分类后制定绿色股票行业，并从中剔除“两高一剩”企业。通过创新有效的绿色评价体系进行综合评分确立指数备选池，考察备选股市场流动性表现后，采用市值排名精选出深港两市各 50 只优质绿色概念股票组成指数样本股。

绿色评价体系由中财大绿经院开发，综合考察企业“绿色表现”的定性和定量指标，以及在企业环境方面的负面舆情指标。

## 指数历史走势（2011 年 1 月 3 日-2017 年 12 月 18 日）



深港通综指用以反映深港跨境市场整体走势

## 收益与波动（日收益）（2017 年 12 月 18 日）

指数	阶段收益				年化收益		年化标准差		夏普比率	
	1 个月	3 个月	1 年	今年以来	3 年	5 年	3 年	5 年	3 年	5 年
深港通绿色优选	-4.21%	4.37%	28.51%	28.00%	12.96%	12.71%	21.55%	19.59%	3.91%	4.17%
深港通综指	-1.98%	0.53%	17.00%	17.66%	7.28%	5.97%	19.34%	17.37%	2.59%	2.27%

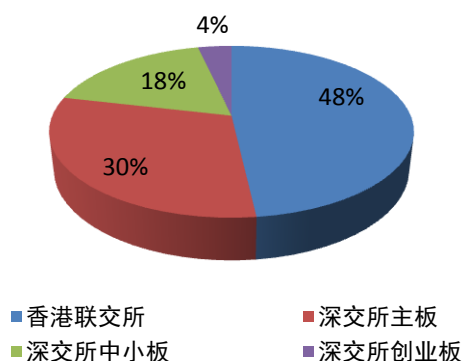
## 分年度收益

指数	2016	2015	2014	2013	2012
深港通绿色优选	-4.27%	17.66%	12.03%	10.41%	16.42%
深港通综指	-4.14%	7.18%	8.51%	0.88%	19.09%

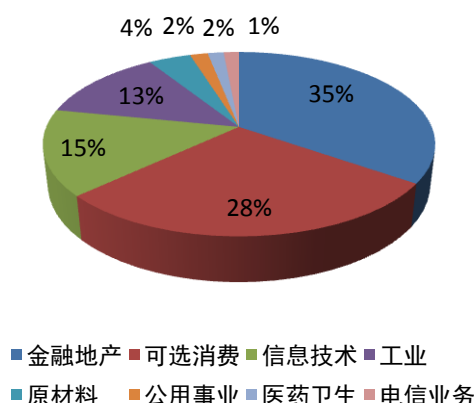
## 统计数据（2017 年 12 月 18 日）

权重 (%)		自由流通市值 (权重调整后, 亿元)				
最大样本	最小样本	合计	最大	最小	均值	中位数
8.67	0.07	25241.56	2188.74	16.59	252.42	143.13

板块分布 (公司数量和权重占比) (2017 年 12 月 18 日)



行业分布 (权重占比) (2017 年 12 月 18 日)



十大权重股 (2017 年 12 月 18 日)

样本	代码	上市交易所	权重 (%)	行业
美的集团	000333	深交所	8.67	可选消费
格力电器	000651	深交所	7.48	可选消费
建设银行	00939	联交所	6.05	金融地产
工商银行	01398	联交所	5.09	金融地产
瑞声科技	02018	联交所	3.34	信息技术
中国银行	03988	联交所	2.95	金融地产
香港交易所	00388	联交所	2.60	金融地产
科大讯飞	002230	深交所	2.13	信息技术
渣打集团	02888	联交所	2.07	金融地产
康得新	002450	深交所	1.89	原材料
总计			42.28	

指数资料

样本股数量	100
加权方式	个股权重按照实际自由流通市值 单个行业设置 35% 的权重上限
基点/基期	1000 点/2011 年 1 月 3 日
定期调整样本股	样本股定期调整时间为每年 1 月与 7 月的第一个交易日
计算频率	在深交所和联交所交易时段每 3 秒钟计算一次
发布日	2017 年 12 月 18 日

代码

指数全称	指数简称	国证代码	Wind 代码
中财-国证深港通绿色优选指数	深港通绿色优选	G10013	G10013.CNI
中财-国证深港通绿色优选收益指数	深港通绿色优选 R	G10014	G10014.CNI
中财-国证深港通绿色优选指数(港币)	深港通绿色优选(港币)	G10015	G10015.CNI
中财-国证深港通绿色优选收益指数(港币)	深港通绿色优选 R(港币)	G10016	G10016.CNI

深证系列指数是深圳证券交易所的资产，深圳证券交易所委托深圳证券信息有限公司负责深证系列指数的研发、运维和营销。国证系列指数是深圳证券信息有限公司的资产。未经深圳证券交易所和深圳证券信息有限公司的授权许可，任何机构和个人不得擅自使用深证系列指数和国证系列指数用作任何商业用途，包括但不限于用作投资组合的业绩比较基准或者产品的标的指数。

以上数据均来源于深圳证券信息有限公司，仅作为信息参考，深圳证券信息有限公司力求数据的正确，但对数据的错误以及由于使用此公开材料所造成的商业损失不承担任何责任。

指数历史表现并不作为未来收益的保证。

如欲知更详细的指数信息，请访问 [www.cnindex.com.cn](http://www.cnindex.com.cn)； 电邮 [index.services@cninfo.com.cn](mailto:index.services@cninfo.com.cn)； 或致电 +86-755 8324 1251