中国证监会投资者保护局
Investor Protection Bureau of CSRC

深圳证券交易所
SHENZHEN
STOCK EXCHANGE

探秘深市ESG指数

深市指数小课堂

牛牛，最近**ESG投资**比这天气还火热！我的投资知识储备也要与时俱进，可以具体说说**ESG投资**嘛？

ESG是环境（**Environment**）、社会责任（**Social**）与公司治理（**Governance**）的缩写。ESG投资倡导可持续发展理念，与我国实现碳达峰碳中和、创新驱动发展、乡村振兴、共同富裕等战略方针高度契合。将指数化投资与ESG投资理念深度融合，正成为全球可持续投资的一种新趋势。

我留意到深交所近日发布了6条**ESG指数**，而且是基于深证成指、创业板指、深证100这3条核心指数开发的。能详细介绍一下吗？

ESG基准指数

- 深证成指ESG基准指数

  简称：**深指ESG**

  代码：970026
- 深证100 ESG基准指数

  简称：**100ESG**

  代码：970027

ESG领先指数

- 深证成指ESG领先指数

  简称：**深指ESG领先**

  代码：970029
- 深证100 ESG领先指数

  简称：**100ESG领先**

  代码：970030

● 创业板指ESG基准指数

简称：**创指ESG**

代码：970028

● 创业板指ESG领先指数

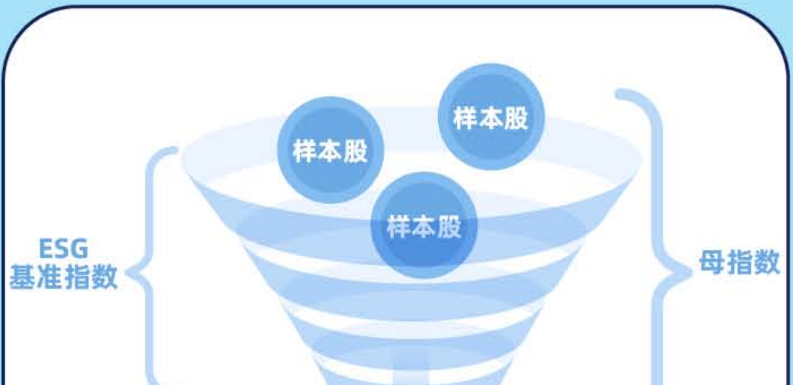
简称：**创指ESG领先**

代码：970031

没问题。本次发布的指数主要包括**ESG基准指数**和**ESG领先指数**两大系列，用来满足市场多元化的ESG投资需求。

ESG基准指数

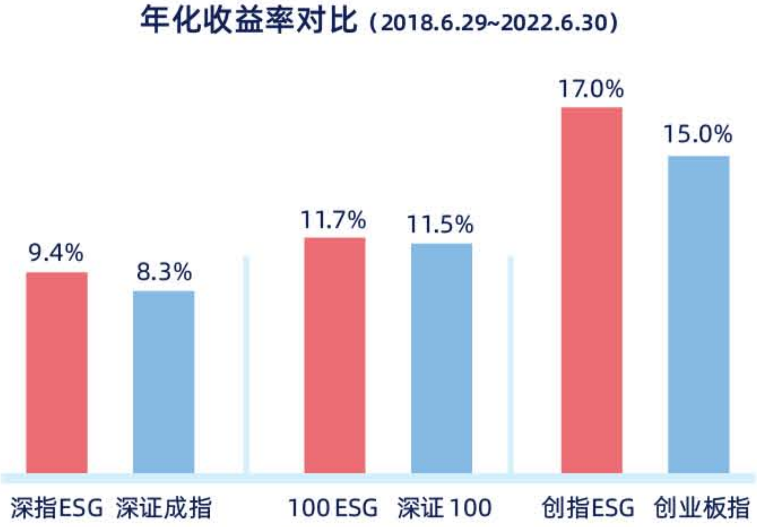
先说说**ESG基准指数**吧！顾名思义，ESG基准指数**定位于ESG投资业绩基准**，以对应核心指数为母指数，对母指数样本股按照**所属国证一级行业**及**国证ESG评分**从高到低排序，剔除ESG评分在所属行业内排名后20%的股票，选取其余股票构成指数样本股。



ESG基准指数剔除了母指数样本股ESG评分在所属行业内排名后20%的股票

也就是说，**深指ESG、100ESG、创指ESG**样本股数量分别为400只、80只、80只喽！那ESG基准指数收益表现如何?

真聪明！从基日2018年6月29日至2022年6月30日来看，ESG基准指数运行特征与母指数保持一致，收益表现略有优势。



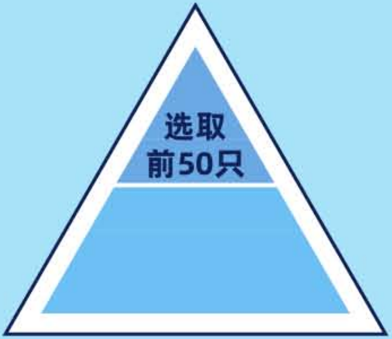
ESG领先指数

原来是这样，那**ESG领先指数**的定位和编制方法呢?
国证ESG

ESG领先指数**定位于优质ESG投资标的**。ESG领先指数将对应核心指数的样本股**按照国证ESG评分**从高到低排序：

- **深指ESG领先**：选取前200只股票作为样本股。
- **创指ESG领先和100ESG领先**：各选取前50只股票作为样本股。

深指ESG领先

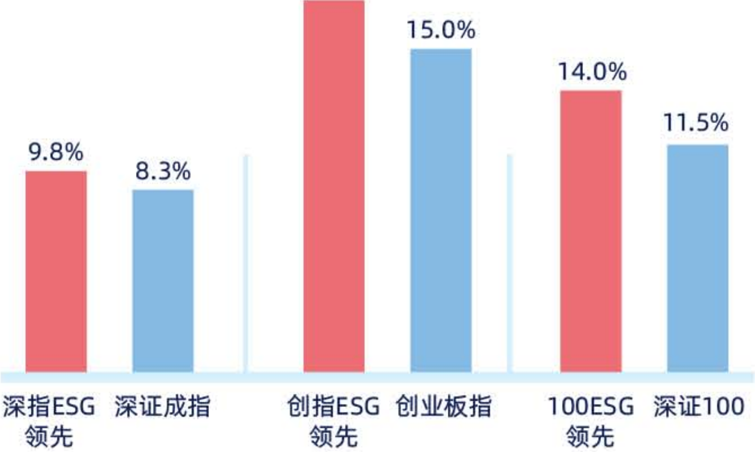


创指ESG领先
100ESG领先

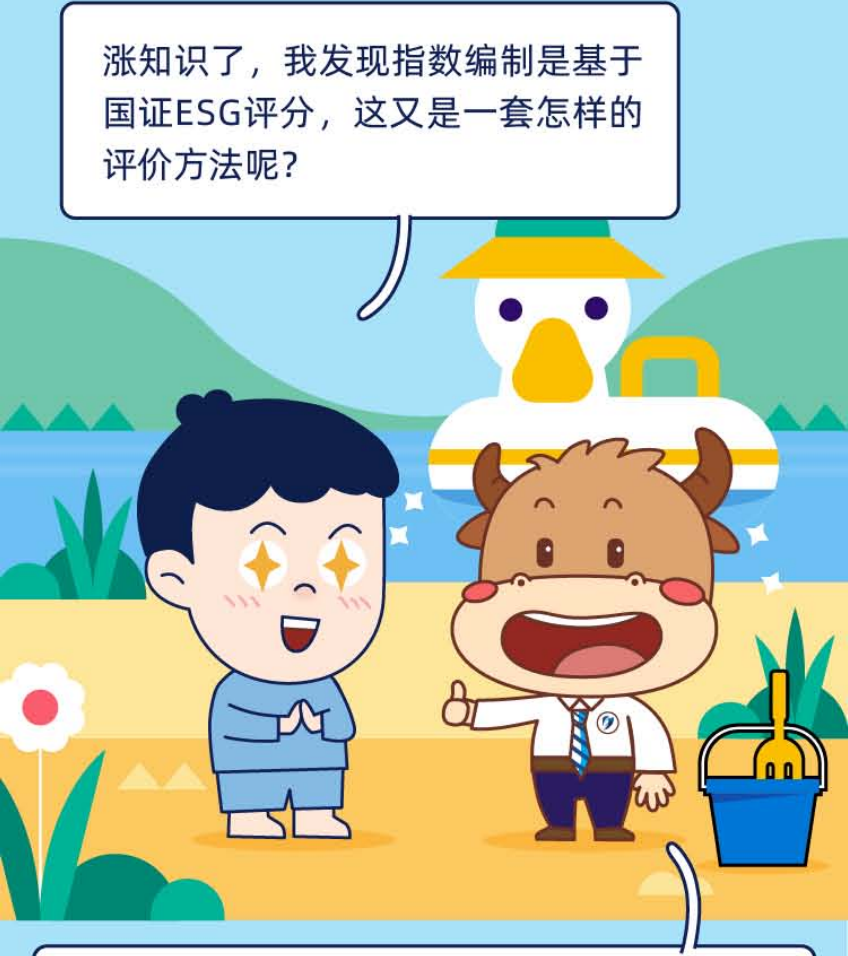
看来ESG领先指数**突出体现ESG因子收益表现**，那我很关心指数收益表现如何？

走势棒棒哒，从基日2018年6月29日至2022年6月30日，深指ESG领先、创指ESG领先和100ESG领先收益表现显著优于母指数，年化超额收益分别达到**1.5%、2.5%、2.5%**。

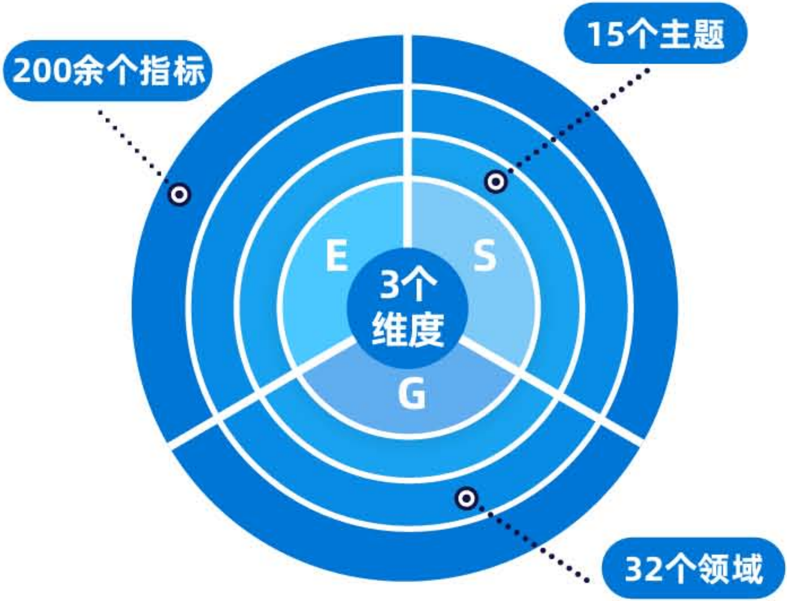
年化收益率对比（2018.6.29~2022.6.30）



国证ESG评价方法


涨知识了，我发现指数编制是基于国证ESG评分，这又是一套怎样的评价方法呢?

问得好，**国证ESG评价方法**是由国证指数自主研发的适应中国市场的ESG评价工具，设计遵循“立足本土、借鉴国际、特色鲜明、关注实效、动态完善”原则，从环境、社会责任、公司治理三个维度全面反映公司可持续发展方面的实践和绩效。



那我知道啦，看来国证ESG评价方法不仅可以用来编制指数，还能作为我投资分析的好帮手！

真是学以致用，国证ESG评价指标数据采集**覆盖全部A股公司**，指标评分基于客观规则和公开信息，评价结果**每季度更新**。关于更多ESG评价方法和ESG指数信息，可以去国证指数网（www.cnindex.com.cn）详细了解哦！

免责声明

免责声明：本文仅为投资者教育之目的而发布，不构成投资建议。投资者据此操作，风险自担。深圳证券交易所力求本文所涉信息准确可靠，但并不对其准确性、完整性和及时性做出任何保证，对因使用本文引发的损失不承担责任。

戴口罩，勤洗手
常通风，少聚集

中国证监会投资者保护局
Investor Protection Bureau of CSRC

深圳证券交易所
SHENZHEN
STOCK EXCHANGE

深交所官方微信公众号

如有疑问，请拨打深交所服务热线 400 808 9999