

新华 CN-ESG 优选 300 指数编制方案

(2021 年 8 月)

新华 CN-ESG 优选 300 指数根据新华 CN-ESG 评价体系，从新华 500 指数样本中选取 ESG 评分较高的 300 只上市公司证券作为指数样本，以反映新华 500 指数中 ESG 评分较高的上市公司证券的整体表现。

一、 指数名称和代码

指数名称：新华 CN-ESG 优选 300 指数

指数简称：新华 ESG300

英文名称：XH·CN-ESG Select 300 Index

英文简称：XH·ESG300

指数代码：989008

二、 指数基日和基点

该指数以 2018 年 12 月 28 日为基日，以 1000 点为基点。

三、 样本选取方法

1. 样本空间

新华 CN-ESG 优选 300 指数以新华 500 指数样本为样本空间

2. 选样方法

对样本空间内证券采用新华 CN-ESG 评价体系，运用 ESG 方法从环境、社会和治理三方面进行评级，依据评级结果选取评分靠前的 300 只上市公司证券作为指数样本。在确定新入选样本股后，在剩余股票中按 ESG 评分从高到低排序选取样本数量 5% 的股票作为备选样本股。

四、 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=

$$\text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum \text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子}}{\sum \text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子}}$$

其中，权重因子介于 0 和 1 之间，以使样本根据 ESG 综

合评级得分调整后的自由流通市值加权，且行业权重与新华 500 指数一致，单个样本权重不超过 10%，前五大样本权重合计不超过 40%。

详见“五、指数样本和权重调整”。

五、 指数样本和权重调整

1. 定期调整

该指数每半年进行样本调整，调整生效日期为每年 6 月和 12 月的第二个星期五后的下一个交易日。每次调整的样本比例一般不超过 20%，除非因不满足样本空间条件被剔除的原样本超过了 20%。

样本设置缓冲区，排名在 210 名内的新样本优先进入指数，排名在 350 名之前的老样本优先保留。

2. 临时调整

特殊情况下将对指数样本进行调整。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照相关方法进行处理。

当出现样本股临时调整，有指数样本股被非样本股替代时，

新进指数的股票一般情况下将继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的收盘权重，并据此计算新进股票的权重因子。

六、 免责声明

新华 CN-ESG 优选 300 指数属于新华指数（北京）有限公司所有，未经书面许可，任何单位和个人不得跟踪、交易该指数，或以指数为评价基准。对任何直接或间接使用本文件及任何信息而造成的损失，包括但不限于因内容不准确、不完整而导致的损失，新华指数（北京）有限公司及其关联方无须承担任何法律责任。