

中证国证富时中国 A 股绿色收入指数编制方案

中证国证富时中国 A 股绿色收入指数从 A 股市场绿色收入占比较高的证券中选取 100 只市值较大的上市公司证券作为指数样本，反映具有绿色业务的上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：中证国证富时中国 A 股绿色收入指数

指数简称：A 股绿色收入

英文名称：FTSE CSI CNI China A Share Green Revenue Index

英文简称：A Share Green Revenue

指数代码：932604

二、指数基日和基点

该指数以 2019 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

指数样本空间由同时满足以下条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：

- (1) 上市时间超过一年，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位；
- (2) 属于沪股通或深股通证券范围；
- (3) 非 ST、*ST 证券。

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

3、选样方法

(1) 对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取经中证指数、深证信息和富时罗素共同认定业务范围涉及绿色领域，且绿色收入占比不小于 10% 的上市公司证券作为待选样本；

(2) 在待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排序，选取排名靠前的 100 只证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%，前五大样本权重合计不超过 40%。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时,将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理,参照计算与维护细则处理。当沪股通或深股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时,指数将相应调整。