

## 中证环保产业指数编制方案

中证环保产业指数从沪深市场中选取 100 只业务涉及资源管理、清洁技术和产品、污染管理等领域的上市公司证券作为指数样本，以反映环保产业上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证环保产业指数

指数简称：中证环保

英文名称：CSI Environmental Protection Industry

英文简称：CSI Environmental Protection

指数代码：000827

### 二、指数基日和基点

该指数以 2011 年 12 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

### 三、样本选取方法

#### 1、样本空间

同中证全指指数的样本空间

#### 2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 在剩余样本中，选取业务涉及环保产业的上市公司证券作为待选样本，包括但不限于以下领域：

- 资源管理：为供水、可回收利用材料生产、清洁能源发电、能源节约与管理等活动提供生产设备、技术、特殊材料、服务、建筑与安装；
- 清洁技术和产品：为能源清洁、资源提效等活动提供生产设备、技术、特殊材料、建筑与安装；
- 污染管理：为空气污染防治、废水管理、固体废弃物管理、噪声消除、环境监测、数据收集等活动提供生产设备、特殊材料、建筑与安装。

(3) 在待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前100的证券作为指数样本。

#### 四、指数计算

指数的计算公式为：

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

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%。

#### 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。