

## 中证内地低碳经济主题指数编制方案

中证内地低碳经济主题指数由清洁能源发电、能源转换及存储、清洁生产及消费与废物处理等公司组成，以反映沪深市场低碳经济主题上市公司证券的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：中证内地低碳经济主题指数

指数简称：内地低碳

英文名称：CSI China Mainland Low Carbon Economy Index

英文简称：Mainland L-C Index

指数代码：000977/399977

### 二、指数基日和基点

该指数以 2010 年 6 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的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 对样本空间剩余证券，将最近一个会计年度在以下业务的收入占比或

利润占比达到 50% 的公司作为待选样本：清洁能源发电（太阳能、风能、核能、水电、清洁煤等）、能源转换及存储（智能电网、电池等）、清洁生产及消费（能源效率等）、废物处理（水处理和垃圾处理）；

（3）在上述待选样本中，按照过去一年的日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 的证券作为指数样本。

#### 四、指数计算

指数计算公式如下：

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

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 15%。

#### 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。