

富时平安中国ESG指数系列

掌握中国股票指数的ESG风险和机遇

概览

作为全球第二大经济体, 中国在实现全球可持续发展目标方面举足轻重。鉴于全球对可持续发展资产的需求快速增长, 对中国公司(A股) 应用严格的环境、社会和治理 (ESG) 标准, 将会成为实现有关目标的重要部分。中国国内和国际市场的公司、监管机构、金融服务供应商及其他行业参与者需共同努力, 才能够汇总、量化和分析高质量的ESG数据和ESG披露。

全球投资者正在开发旨在将ESG考量整合到投资的被动型策略, 有关策略日渐成熟。中国的可持续发展市场也不例外, 中国A股被纳入国际指数, 再次引起了全球投资者对可持续发展表现的关注和兴趣。

为了满足投资者需求, 富时罗素和中国平安携手构建了富时平安中国ESG指数系列, 结合了中国平安的中国特色ESG数据和富时罗素领先的中国基准指数。

富时平安中国ESG指数系列促使投资者在中国蓬勃发展且具有战略意义的资本市场上获取机遇, 并将资金导向到ESG表现出色的公司。

首次推出的富时平安中国ESG指数系列由以下ESG组成:

- 富时平安中国A股自由流通ESG先进50指数
- 富时平安中国A股自由流通ESG先进100指数

特色

中国特色ESG评分

中国特定ESG方法论最适合中国独特的发展趋势, 以及其政策主导的社会和环境情况。

评估中国的ESG机遇和风险

平安的CN-ESG评分体系提供独特分析, 帮助投资者认识政策驱动下绿色主题投资机遇中的环境和绿色行业, 以及理解重大社会和治理的观点。

具有代表性和全面性的基准指数

指数系列基于富时中国A股自由流通指数, 该指数是中国A股市场具代表性的综合基准, 涵盖在上海和深圳证券交易所(包括创业板)上市的大中盘股。

不设外国所有限制

外国所有限制不适用于富时中国A股自由流通指数, 因此能准确地向国内投资者反映中国市场情况。

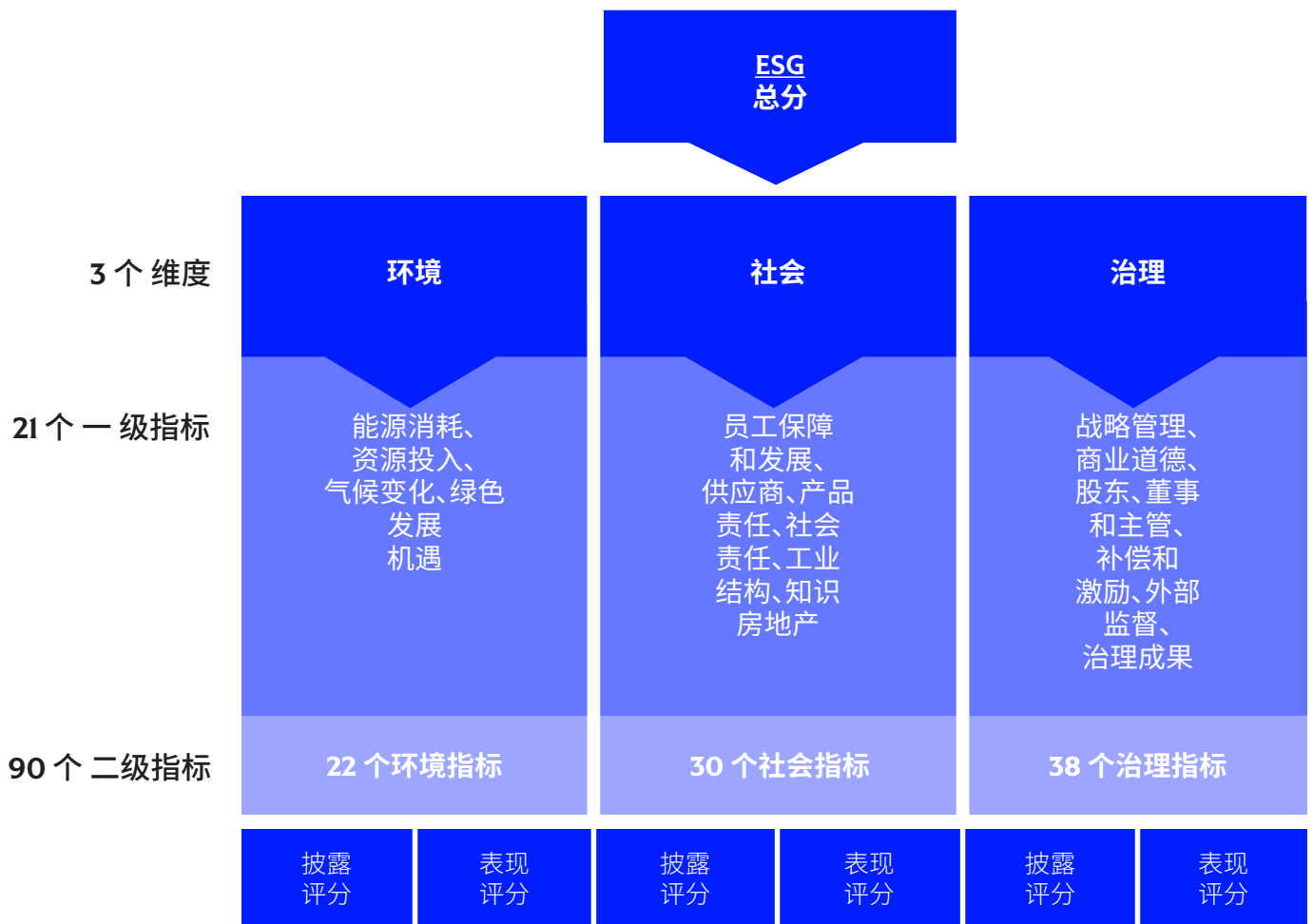
结合人工智能和中国特色的新一代ESG评分

关于平安CN-ESG评估框架

富时平安中国ESG指数系列是一个中国股票指数系列，采用平安CN-ESG评分体系，以衡量在环境、社会和治理 (ESG) 方面表现出色的公司有关表现。

指数使用平安CN-ESG框架的整体评分，以调整其成分股的市值权重。

平安CN-ESG框架覆盖4,000多只中国A股，主要指标分为三大类：通用指标、行业指标、新闻情绪指标。在通用指标基础上，该框架结合行业具体特征、政府处罚和公众新闻情绪等因素，全面评估中国公司的ESG表现。



指数构建流程

初始范围

以市值加权指数富时中国A股自由流通指数作起点。

步骤 1 计算ESG评分

通过中国平安的CN-ESG框架,获取相关指数中每家公司的ESG评分

步骤 1 将评分转为指数权重

从行业分类标准系统(ICB)的10个行业(金融和房地产被视为一个行业)中各选择ESG评分排名前5或前10的公司从最高到最低排名,并按市值对成分股进行加权。单一成分股将有10%的权重上限。

步骤 1 发布和审核指数

在3月和9月每半年审核一次。

关于中国平安

中国平安

专业·价值

中国平安保险(集团)公司(“平安”)是世界领先的科技驱动型零售金融服务集团。中国平安拥有超过2.25亿零售客户和近6.34亿互联网用户,属于全球最大金融服务公司之一。中国平安聚焦“泛金融资产”和“泛医疗保健”两大业务领域,通过我们的综合金融服务平台,以及我们在金融、医疗保健、汽车服务和智慧城市服务等生态系统,提供金融和医疗保健服务。我们的“金融+科技”和“金融+生态”转型战略旨在利用科技为客户和互联网用户提供创新简单的产品和服务。中国平安作为中国第一家股份制保险公司,致力坚持最高标准的公司报告和公司治理。该集团于香港及上海证券交易所上市。中国平安位列2021年《福布斯》全球2000强的第6位,2021年《财富》世界500强的第16位。中国平安还在2021年WPP Kantar Millward Brown BrandZ™的“全球最具价值品牌100强”中位列第49位。

FTSE Russell 免责声明

© 2022 London Stock Exchange Group plc和旗下企业(统称“LSE Group”)。LSE Group包括(1) FTSE International Limited (“FTSE”)、(2) Frank Russell Company (“Russell”)、(3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. 和FTSE Global Debt Capital Markets Limited (统称“FTSE Canada”)、(4) FTSE Fixed Income Europe Limited (“FTSE FI Europe”)、(5) FTSE Fixed Income LLC (“FTSE FI”)、(6) The Yield Book Inc (“YB”) 和 (7) Beyond Ratings S.A.S. (“BR”)。版权所有。

FTSE Russell® 是 FTSE、Russell、FTSE Canada、FTSE FI、FTSE FI Europe、YB 和 BR 的商号。“FTSE®”、“Russell®”、“FTSE Russell®”、“FTSE4Good®”、“ICB®”、“The Yield Book®”、“Beyond Ratings®” 和本文件使用的所有其它商标和服务商标(不论注册与否) 都是LSE Group适用的成员或其各自的授权人拥有或授权的商标和/或服务商标,并由 FTSE、Russell、FTSE Canada、FTSE FI、FTSE FI Europe、YB、BR 拥有或根据授权使用。FTSE International Limited 作为基准管理人,由Financial Conduct Authority 授权和监管。

本文件提供的所有信息仅作参考用途。本文件包括的所有信息和数据都由LSE Group从其认为准确和可靠的来源取得。然而,鉴于可能发生人为和机械错误和其它因素,有关信息和数据乃按“现状”提供,并不附带任何种类的保证。LSE Group的成员公司及其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或授权人概不就任何信息的准确性、时效性、完整性及可适用性,或使用FTSE Russell产品,包括但不限于指数、数据及分析产品,取得的结果,或FTSE Russell产品可能声称的特定用途的适用性或适合性,做出任何明示或暗示的声明、预测、保证或陈述。任何从FTSE Russell产品获得的过往数据仅作参考用途,并非未来业绩的可靠指标。

LSE Group的成员公司及其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或授权人概不就以下情况负法律责任或承担责任:(a) 任何与采购、收集、编纂、诠释、分析、编辑、转录、传输、传播或传递任何该等信息或数据,或由于使用本文件或其链接而导致、引发或与之有关的任何错误(无论由于疏忽与否) 或其它情况相关的全部或部分损失或损害;或(b) 任何由于使用或不能使用该等信息所导致的直接、间接、特殊、随之发生或附带的损害,尽管LSE Group的成员公司已在前取得可能出现该等损害的意见。

LSE Group的成员公司及其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或授权人概不提供投资建议,且本文件包括的信息不应被视为理财或投资建议。LSE Group的成员公司及其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或授权人,皆未表示应该投资任何类别的资产,亦不表示投资以上类别资产是否构成法律或是合规风险。此处的信息不应被作为基准而作出投资决定。指数不可直接投资。将一项资产纳入指数并不意味着建议购买、出售或持有该资产,也不意味着任何特定投资者可以合法购买、出售或持有该资产或包含该资产的指数。本文件之一般信息应作为参考使用,若需根据本文件内容进行交易,请取得有执照之专业人士的法律、税务以及投资方面的专业建议。

过往业绩并非未来业绩的保证。所提供的图表仅作参考用途。所显示的指数收益未必代表可投资资产的实际交易结果。所显示的个别收益可能反映回溯测试的业绩。所有在指数成立日期之前的业绩均为回溯测试业绩。回溯测试业绩只是假设数据,并非实际业绩。回溯测试的计算方法与指数正式推出时所应用的方法相同。不过,回溯测试数据可能反映有后见之明地应用指数编制方法的影响,且视乎计算指数所使用之基础经济数据的修正情况,过往指数的计算结果可能出现按月变化。

本文件可能包括前瞻性评估。这些评估是以有关未来情况的假设为依据,而这些假设最终可能并不准确。这些前瞻性评估受制于风险和不确定因素,并有可能受到不同的可能导致实际结果出现显著差异的因素的影响。LSE Group的成员公司或其授权人概不负责和不保证更新前瞻性评估。

如未预先取得 LSE Group 适用成员公司的书面同意,任何人士不得以任何形式或以任何电子、机械、影印、录制或其它方法,复制、储存于检索系统或传输本文件的任何部分。如要使用和发布 LSE Group 的数据,必须事先取得 FTSE、Russell、FTSE Canada、FTSE FI、FTSE FI Europe、YB、BR 和/或其各自授权人的授权。

关于富时罗素

富时罗素是全球领先的指数供应商,构建和管理广泛指数、数据和分析解决方案,以满足客户在资产类别、风格和策略方面的需求。富时罗素旗下指数覆盖98%可投资市场,提供全球市场真实情况,并结合来自开发全球本地基准获得的专业知识。富时罗素的指数专业知识和产品被全球机构和散户投资者广泛使用。30多年来,领先的资产所有者、资产管理公司、ETF 供应商和投资银行均选择富时罗素指数,作为投资表现的基准,并构建投资基金、ETF、结构性产品和指数衍生品。富时罗素指数还为客户提供资产配置、投资策略分析和风险管理工具。一套核心通用原则指导富时罗素指数的设计和管理:由领先市场参与者组成的独立委员会提供透明而基于规则的指数计算规则。富时罗素专注指数创新和客户合作,采用最高行业标准,并遵循IOSCO原则。富时罗素由伦敦证券交易所集团全资拥有。更多信息,请到访 ftserussell.com。

如需更多详情,请访问 lseg.com/ftse-russell; 发送电邮至 info@ftserussell.com; 或致电您所在地区的 客户服务团队办公室:

欧洲、中东和非洲 +44 (0) 20 7866 1810

北美 +1 877 503 6437

亚太区

香港 +852 2164 3333

东京 +81 (3) 6441 1430

悉尼 +61 (0)2 7228 5659



**FTSE
RUSSELL**
An LSEG Business



**SUSTAINABLE
GROWTH**