

STOXX® 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数

指数说明

STOXX 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数从 STOXX 中国 A 股 900 指数内自由流通市值最大的 300 只证券中挑选成分股。该指数在保持与大盘类似风险特征的情况下，建立一个更具优势的 ESG 投资组合。

该指数使用绿色金融国际研究院 (IIGF) 的数据来进行排除筛选。被 IIGF 评估为不符合联合国全球契约原则的公司，或涉及有争议武器、烟草或热能煤的企业都不具备入选资格。然后使用 Axioma 的投资组合优化软件确定最终的选股与权重，以便在可预测风险、可交易性和多样化约束条件下，最大化指数的 IIGF ESG 总体分数。

关键资料

- » 选自 STOXX 中国 A 股 900 指数大盘证券
- » 优化选股和权重以使投资组合的 ESG z 分数最大化
- » 应用可预测风险、可交易性和多样化的约束条件
- » 使用 Axioma 的投资组合优化软件
- » ESG 数据来自绿色金融国际研究院 (IIGF)

描述性统计

指数	市值 (十亿人民币)			成分股 (十亿人民币)			成份股权重 (%)		成交量 (%)
	全部	自由流通	均值	中间值	最大值	最小值	最大值	最小值	过往 12 个月
STOXX 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数	N/A	92.9	0.8	0.3	6.2	0.0	6.7	0.0	44.2
STOXX 中国 A 股 900 指数	46,499.2	22,199.9	24.7	12.1	1082.0	5.0	4.9	0.0	10.1

行业权重占比 (前十)



国家权重占比

风险和回报数据¹

指数回报率	回报率 (%)					年化回报率 (%)				
	上月	今年迄今	1年	3年	5年	上月	今年迄今	1年	3年	5年
STOXX 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数	-6.0	-16.6	-14.6	19.3	25.0	N/A	N/A	-14.5	6.0	4.6
STOXX 中国 A 股 900 指数	-6.7	-20.0	-18.0	10.1	3.8	N/A	N/A	-18.0	3.3	0.8

指数波动与风险	年化波动率					年化夏普比率 ²				
	上月	今年迄今	1年	3年	5年	上月	今年迄今	1年	3年	5年
STOXX 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数	14.1	19.0	17.6	18.9	19.3	N/A	N/A	-0.7	0.3	0.3
STOXX 中国 A 股 900 指数	15.2	20.3	18.5	19.3	19.8	N/A	N/A	N/A	0.2	0.1

基准指数	相关性					跟踪误差 (%)				
	上月	今年迄今	1年	3年	5年	上月	今年迄今	1年	3年	5年
STOXX 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数	1.0	1.0	1.0	1.0	1.0	3.8	4.5	4.4	4.6	4.7

基准指数	Beta 值					年化信息比率				
	上月	今年迄今	1年	3年	5年	上月	今年迄今	1年	3年	5年
STOXX 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数	0.9	0.9	0.9	1.0	0.9	2.4	1.7	1.3	0.6	0.9

¹ 有关数据计算的资料，请参阅 STOXX 的计算参考指引。

² 基于 EURIBOR1M

(人民币，总回报)，所有数据截至 2022 年 9 月 30 日

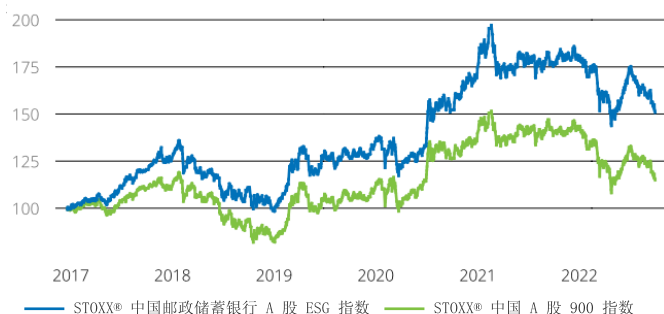
STOXX 指数

STOXX® 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数

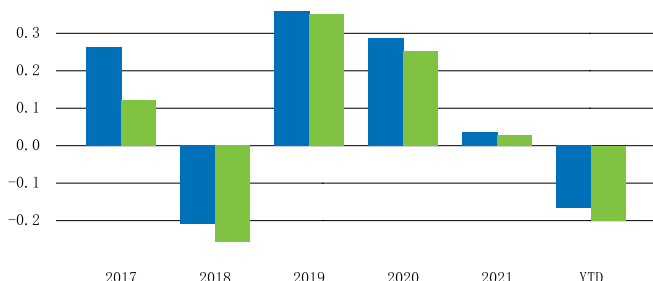
基本面 (过去 12 个月)

指数	市盈率 (含负债)		市盈率 (不含负债)		市净率	股息收益率 (%) ³	市销率	股价现金流比率
	往绩	预测	往绩	预测				
STOXX 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数	10.9	9.9	10.7	9.7	1.3	2.1	0.8	N/A
STOXX 中国 A 股 900 指数	14.7	12.1	12.6	11.7	1.5	1.7	1.0	21.7

表现和每年回报⁴



— STOXX® 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数 — STOXX® 中国 A 股 900 指数



■ STOXX® 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数 ■ STOXX® 中国 A 股 900 指数

编制方法

STOXX 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数从 STOXX 中国 A 股 900 指数内自由流通市值最大的 300 只证券中挑选成分股。被 IIGF 评估为不符合联合国全球契约原则的公司，或涉及有争议武器、烟草或热能煤的企业都不具备入选资格。其余的证券根据 IIGF 提供的 ESG 得分进行筛选。然后通过 Axioma 的投资组合优化软件，利用 Axioma 中国中期股票因素风险模型构建投资组合，其目标是在可预测风险、可交易性和多样化的约束条件下，最大化指数的总体 ESG z 分数。

版本与代码

指数	国际证券识别码	代码	彭博	路透
总回报 人民币	CH1159269088	SPCESGNN	SPCESGNN 指数	.SPCESGNN
总回报 人民币	CH1159269088	SPCESGNN	SPCESGNN 指数	.SPCESGNN
净回报 人民币	CH1159268999	SPCESGNN		.SPCESGNN
价格 人民币	CH1159269047	SPCESGN		.SPCESGN
总回报 欧元	CH1159268981	SPCESGGR		.SPCESGGR
净回报 欧元	CH1159269013	SPCESGNR		.SPCESGNR
价格 欧元	CH1159269062	SPCESGR		.SPCESGR
总回报 日元	CH1159269096	SPCESGJ		.SPCESGJ
净回报 日元	CH1159269005	SPCESGJ		.SPCESGJ
价格 日元	CH1159269054	SPCESGJ		.SPCESGJ

完整名单请浏览：www.stoxx.com/data/vendor_codes.html

数据摘要

权重占比	优化
成分股数目	不固定
评审周期	季度 (3 月、6 月、9 月、12 月)
计算/发布	实时, 15 秒
计算时段	00:00:00 18:00:00
基值/基期	100 (截至 2016 年 12 月 19 日)
历史数据	自 2016 年 12 月 19 日起
成立日期	2022 年 1 月 21 日

如需了解成立日期、货币、计算时段和历史价值的详情，请参阅我们的数据供应商代码表。

联系方式

STOXX 客户支持 | P +41 43 430 7272 | customersupport@stoxx.com | <https://qontigo.com/support/>

免责声明

STOXX、Deutsche Boerse Group (DBAG) 及其许可人、研究伙伴或数据提供者不对指数数据的及时性、顺序、准确性、完整性、时效性、适用性、质量、或任何特定目的的适用性作出任何明示或暗示的保证或陈述，且对此不负任何法律责任。STOXX、DBAG 及其许可人、研究伙伴或数据提供者并未通过发布指数或相关内容提供任何投资建议。特别是，将一家公司纳入指数、计算该公司的权重或将该公司从指数中剔除，并不代表 STOXX、DBAG 及其许可人、研究伙伴或数据提供者对该公司的优劣有任何看法。STOXX、DBAG 及其许可人、研究伙伴或数据提供者并未保存、认可、销售或推广基于 STOXX® 指数、DAX® 指数或由 STOXX 支持的任何其他指数的金融工具。

回溯测试的表现

本文件包含回溯测试的指数表现数据，即：假设该指数原已存在，采用相同的指数方法并基于过往的成分股，来推算该指数在成立之前可能的表现。回溯测试的表现信息纯属假设，因此本文件中提供的此类信息仅供参考。回溯测试的表现不代表实际业绩，也不能理解为实际业绩的指标。

定制

可基于该指数定义 STOXX® 定制指数，以满足特定的客户或投资委托需求。STOXX 可以提供几乎各种形式的定制，例如成分股选择、加权方案以及个性化的计算方法。

³ 总股息收益率的计算方法是用总回报指数的回报率减去价格指数的回报率

⁴ STOXX 数据由 2016 年 12 月 19 日起至 2022 年 9 月 30 日止

(人民币, 总回报), 所有数据截至 2022 年 9 月 30 日

STOXX 指数

STOXX® 中国邮政储蓄银行 A 股 ESG 指数

十大成分股⁵

公司	行业	国家	权重 (%)
Moutai 'A'	食物, 饮料 & 烟草	中国	6.70
TONGWEI 'A'	食物, 饮料 & 烟草	中国	5.19
CHINA YANGTZE PWR. 'A'	公用事业	中国	4.90
PING AN INSUR GP CO. OF CN 'A'	保险	中国	4.72
Wuliangye 'A'	食物, 饮料 & 烟草	中国	4.67
CHINA VANKE 'A'	房地产	中国	3.16
ZHEJIANG HUAYOU COB. 'A'	基础资源	中国	2.97
CHINA MERCHANTS BANK 'A'	银行	中国	2.81
CHINA RAILWAY GROUP 'A'	建造 & 材料	中国	2.60
INDSTRL & COML BK. OF CHINA 'A'	银行	中国	2.46

^s 根据截至 根据截至 2022 年 9 月 30 日