

碧桂园·沪深 ESG100 优选指数月度运行报告

2022 年 06 月

指数概况：2019 年 8 月 20 日，新浪财经同国内领先的责任投资和绿色金融专业服务机构商道融绿联合发布碧桂园·沪深 ESG100 优选指数。碧桂园·沪深 ESG100 优选指数依据商道融绿自主开发的 A 股 ESG 评估体系，在中证 800 成分股中，剔除发生过近期发生重大 ESG 负面事件的样本股，再在剩余的样本股中选取 ESG 得分较高的前 100 支股票作为本指数成分股，根据股本权重构建本指数。

一、碧桂园·沪深 ESG100 优选指数的市场行情表现

(一) 整体表现

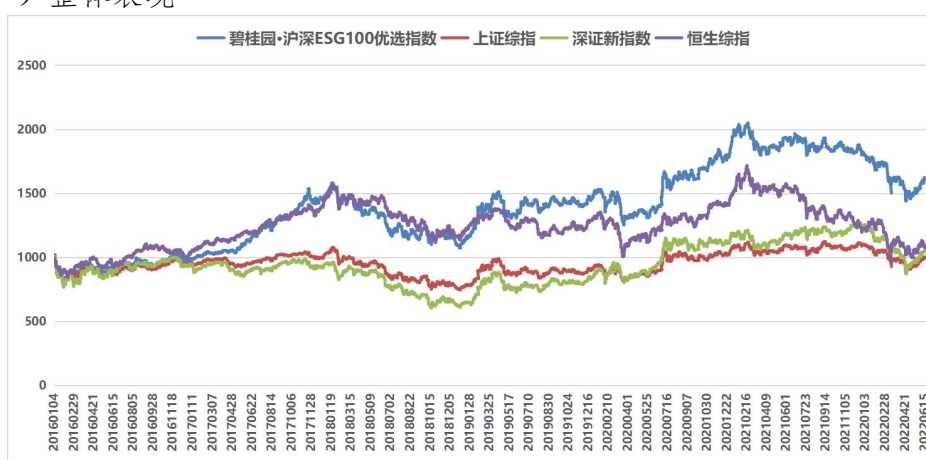


图 1 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数的历史净值（2016/1/4-2022/6/17）

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿

近三年来，碧桂园·沪深 ESG100 优选指数的年化收益显著高于上证综指、深证新指与恒生综指。投资者在 2016 年 1 月 4 日投资 100 元于碧桂园·沪深 ESG100 优选指数，在 2022 年 06 月 17 日可以获得 162.1 元，相较于同一条件下投资上证综指所获得的 100.6 元、投资深证新指数所获得的 106.7 元以及投资恒生综指所获得的 108.6 元，存在超额收益。

表 1 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数与基准指数的绩效（2022/06/17）

指数名称	阶段收益 (%)			年化收益 (%)	
	1个月	3个月	1年	年初至今	3年
碧桂园·沪深ESG100优选指数	7.39	1.62	-13.99	-9.99	6.34
上证综指	7.21	3.16	-5.92	-8.27	4.73
深证新指数	10.02	0.45	-7.84	-14.13	12.55
恒生综指	2.47	-2.22	-28.52	-11.93	-4.21

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿

长期来看，碧桂园·沪深 ESG100 优选指数近三年来的年化收益率显著高于上证综指和恒生综指，体现其较高的持续增长潜力。

(二) 行业表现

基于 Wind 一级行业划分，碧桂园·沪深 ESG100 优选指数中的成分股覆盖了

11 个行业，以金融、工业、信息技术、材料、医疗保健为主，其权重占比分别为 22%、18%、17%、14%、12%。

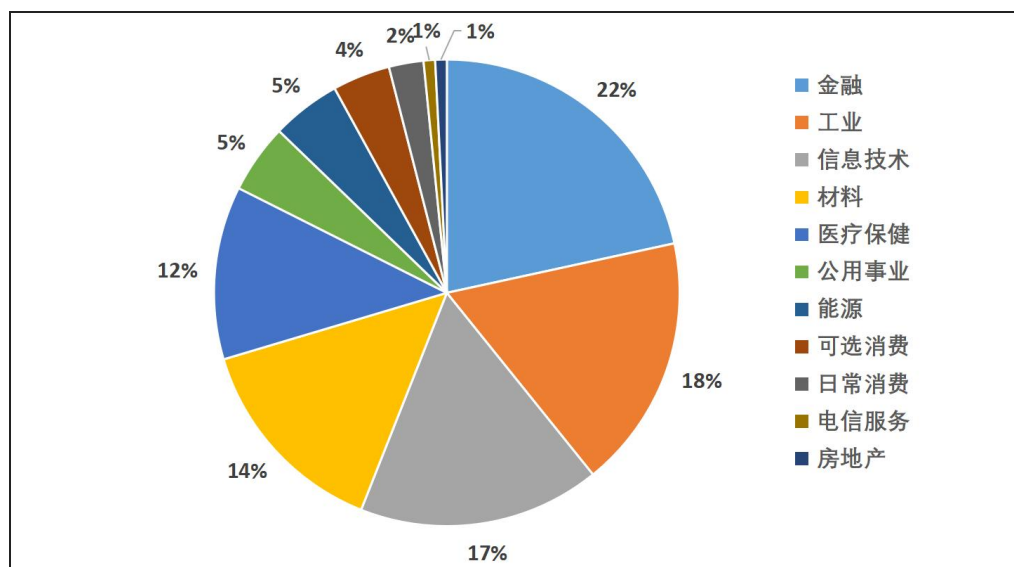


图 2 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数成分股行业权重 (2022/06/17)

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿

(三) 个股表现

深入个股行情表现，碧桂园·沪深 ESG100 优选指数的前十大权重股样本中，有 3 家集中分布在金融行业，2 家分布在信息技术，其余 5 家则分布于可选消费、医疗保健、日常消费、公用事业和材料。

表 2 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数前十大权重股样本 (2022/06/17)

上市代码	最新名称	近一月涨幅	自由流通市值 (亿元)	占比	一级行业
600036.SH	招商银行	3.24%	6577	9.51%	金融
601318.SH	中国平安	7.33%	5095	7.37%	金融
601012.SH	隆基股份	21.56%	3689	5.33%	信息技术
002594.SZ	比亚迪	19.65%	3677	5.32%	可选消费
000001.SZ	平安银行	-1.77%	2804	4.05%	金融
603259.SH	药明康德	-2.91%	2461	3.56%	医疗保健
600887.SH	伊利股份	4.42%	2451	3.54%	日常消费
600900.SH	长江电力	2.61%	2147	3.10%	公用事业
002415.SZ	海康威视	10.40%	1956	2.83%	信息技术
600309.SH	万华化学	15.44%	1793	2.59%	材料

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿

同时，碧桂园·沪深 ESG100 优选指数从 2022 年 05 月 19 日至 2022 年 06 月 17 日的近一个月期间，涨幅排名第一名光大证券 (601788.SH)，跌幅第一名为福莱特 (601865.SH)。



图 3 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数成分股市场表现排名（2022/05/19-2022/06/17）

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿

二、本月 ESG 前沿热点

政策发布

2022 年 6 月 1 日，国家发改委、国家能源局等九部门联合印发《“十四五”可再生能源发展规划》（以下简称《规划》），明确到 2025 年，可再生能源年发电量达到 3.3 万亿千瓦时左右。“十四五”时期，可再生能源发电量增量在全社会用电量增量中的占比超过 50%，风电和太阳能发电量实现翻倍。

2022 年 5 月 30 日，国家发改委、国家能源局发布《关于促进新时代新能源高质量发展的实施方案》，提出，要实现到 2030 年风电、太阳能发电总装机容量达到 12 亿千瓦以上的目标，加快构建清洁低碳、安全高效的能源体系。

2022 年 5 月 25 日，财政部公布，为推动如期实现碳达峰碳中和目标，现印发《财政支持做好碳达峰碳中和工作的意见》。其中指出，到 2025 年，财政政策工具不断丰富，有利于绿色低碳发展的财税政策框架初步建立，有力支持各地区各行业加快绿色低碳转型。

2022 年 6 月 1 日，银保监会发布《银行业保险业绿色金融指引》，扩大覆盖机构范围至银行业和保险业，统筹了环境、社会、治理（ESG）因素，是第一份保险业绿色金融发展指导文件，且对保险机构资产端和负债端均提出了绿色发展要求。

2022 年 6 月 1 日，中国企业改革与发展协会（CERDS）发布的“企业 ESG 披露指南”正式生效。该指南包括一个企业 ESG 披露指标体系，包括环境、社会和治理三个维度，并为 ESG 披露提供了一个基本框架。

国内资讯

2022 年 5 月 19 日，由中国钢铁工业协会主办，中国宝武钢铁集团承办的钢铁行业环境产品声明（EPD）平台启动暨首发仪式在京举行，旨在携手钢铁行业及上下游众多企业及机构，共同推进钢铁行业绿色、健康、可持续发展。

2022 年 5 月 20 日，同济大学联合全球信息分析机构爱思唯尔，发布了《同济大学可持续发

展科研创新报告——全球视角下高校对可持续发展目标的科研贡献》报告。报告显示，中国高校正成为实现可持续发展目标的关键力量。

2022年5月24日，中国气候变化事务特使解振华在2022年世界经济论坛年会表示，中国力争10年内植树700亿棵，在实现“2020年后全球生物多样性框架”方面发挥的作用，以及保持自然和气候行动势头采取的新举措。

2022年5月27日，Choice数据显示今年以来已成立14只ESG投资基金，同比翻倍。从整体看，年内新成立的ESG投资基金规模近70亿元，比去年同期多出60%。

2022年6月7日，上交所修订发布特定品种公司债券指引，新增推出低碳转型债券、低碳转型挂钩债券品种。这是继绿色债券之后，上交所全新推出的用于支持经济社会绿色发展的债券品种，有助于进一步丰富ESG债券品类，提升债券市场服务国家战略和实体经济能力。

2022年6月8日，生态环境部发布《关于高效统筹疫情防控和经济社会发展调整2022年企业温室气体排放报告管理相关重点工作任务的通知》，延长2021年度发电行业重点排放单位碳排放核查等工作的完成时限，考虑到新冠疫情影响，各地可延至2022年9月底前完成上述工作。

2022年6月15日，第十个“全国低碳日”主场活动由生态环境部、山东省人民政府联合在山东济南举办。

2022年6月17日，由联合国环境规划署驻华代表处主办的北京2022年冬奥会和冬残奥会绿色和可持续性良好实践和典型案例分享会在中国北京联合国大楼通过线上和线下方式举办。

国际消息

2022年5月19日，金砖国家新开发银行召开的第七届理事会年会了解到，理事会批准了新开发银行第二个五年战略（2022年—2026年）。未来五年，新开发银行将为成员国提供300亿美元资金支持，其中有40%的资金将被用于减缓气候变暖的进程。

2022年5月23日，美国证券交易委员会（SEC）宣布纽约梅隆银行的投资部门涉及在管理的基金中，误导性描述其ESG投资理念，在2018至2021年期间，多支基金未展开有质量的ESG审查。公司同意以150万美元的金额和解，同时不用承认或否认相关指控的真实性。

2022年5月24日，非洲开发银行行长阿金武米·阿德西纳在加纳首都阿克拉举行的非洲开发银行年会上说，该行将在2025年前融资250亿美元支持非洲应对气候变化。

2022年6月2日，SDSN发布《可持续发展报告2022》，报告显示，在同时发生的多重国际危机之下，SDGs这一全球目标的进展停滞不前。

2022年6月15日，MSCI发布主题报告《ESG与中国战略性政策转变的联系》，显示仅有6%的中国公司符合了《巴黎协定》当中的1.5℃的升温目标，仅有40%是符合2℃的升温目标，两者比例均低于MSCI全球指数的成分股。