

碧桂园·沪深 ESG100 优选指数月度运行报告

2022 年 05 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

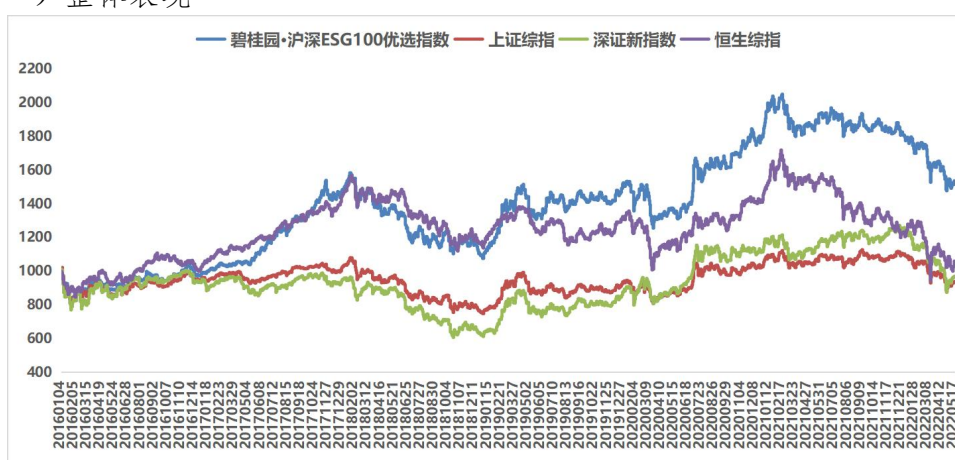


图 1 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数的历史净值（2016/1/4-2022/5/18）

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿咨询有限公司

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 05 月 18 日可以获得 153.6 元，相较于同一条件下投资上证综指所获得的 93.9 元、投资深证新指数所获得的 97.0 元以及投资恒生综指所获得的 105.9 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（2022/05/18）

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	-5.15	-12.41	-18.82	-15.01	4.93
上证综指	-3.66	-10.79	-12.05	-14.44	2.39
深证新指数	-3.69	-15.45	-15.09	-21.95	8.26
恒生综指	-4.76	-17.84	-29.57	-14.05	-5.75

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿咨询有限公司

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%。

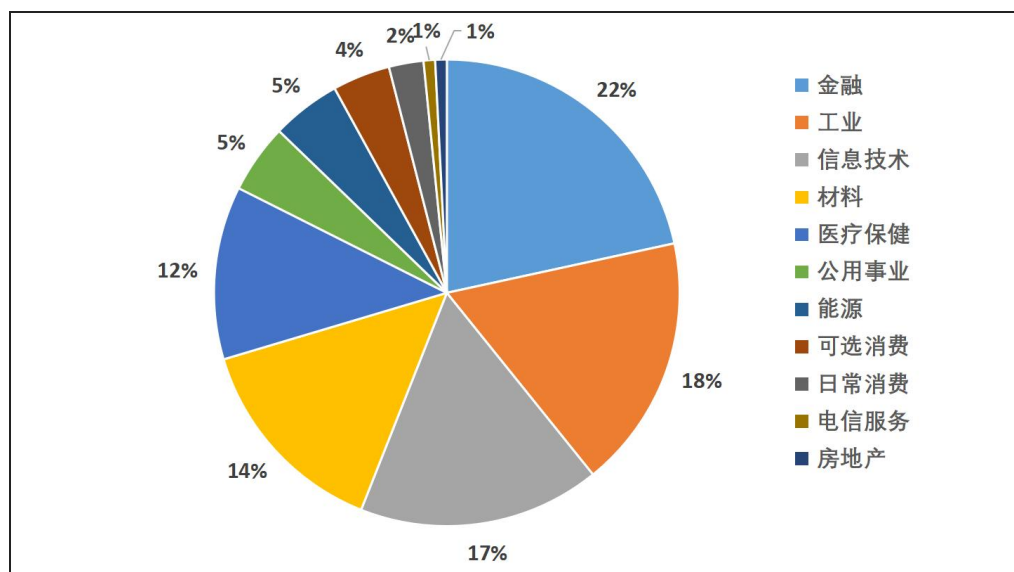


图 2 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数成分股行业权重 (2022/05/18)

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿咨询有限公司

(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 4 家集中分布在金融行业，2 家分布在信息技术，其余 4 家则分布于可选消费、医疗保健、日常消费和公用事业。

表 2 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数前十大权重股样本 (2022/05/18)

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
601398.SH	工商银行	-2.10%	7538	10.69%	金融
600036.SH	招商银行	-17.57%	6370	9.04%	金融
601318.SH	中国平安	-9.28%	4747	6.73%	金融
002594.SZ	比亚迪	19.60%	3073	4.36%	可选消费
601012.SH	隆基股份	5.89%	3045	4.32%	信息技术
000001.SZ	平安银行	-10.41%	2855	4.05%	金融
603259.SH	药明康德	-8.93%	2548	3.61%	医疗保健
600887.SH	伊利股份	-2.56%	2408	3.41%	日常消费
600900.SH	长江电力	-1.71%	2092	2.97%	公用事业
002415.SZ	海康威视	-19.38%	1822	2.58%	信息技术

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿咨询有限公司

同时，碧桂园·沪深 ESG100 优选指数从 2022 年 04 月 19 日至 2022 年 05 月 18 日的近一个月期间，涨幅排名第一名沪电股份 (002463.SZ)，跌幅第一名为柳钢股份 (601003.SH)。



图 3 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数成分股市场表现排名（2022/04/19-2022/05/18）

资料来源：新浪财经 ESG 评级中心 商道融绿咨询有限公司

二、本月 ESG 前沿热点

政策发布

2022 年 4 月 25 日，国务院发布《关于进一步释放消费潜力促进消费持续恢复的意见》，文件提出推动绿色建筑规模化发展，大力发展装配式建筑，积极推广绿色建材，加快建筑节能改造。

2022 年 4 月 26 日，证监会发布《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》，强调公募基金行业要积极践行社会责任，引导行业总结 ESG 投资规律，大力发展绿色金融，积极践行责任投资理念，并对公募基金管理人履行社会责任等情况等进行综合评价。

2022 年 5 月 10 日，国家发改委正式发布《“十四五”生物经济发展规划》。首次提出生物经济规划的概念，《规划》提出，大力发展生物能源与生物环保产业，并被明确列为生物经济支柱产业。

2022 年 4 月 21 日，银保监会和交通运输部联合印发《关于银行业保险业支持公路交通高质量发展的意见》，鼓励银行保险机构为符合条件的绿色低碳公路项目提供金融支持。

2022 年 5 月 13 日，银保监会发布《关于银行业保险业支持城市建设和治理的指导意见》，鼓励银行保险机构积极稳妥参与碳市场建设，加强前瞻性研究和碳金融业务模式研究，防止“一刀切”和“运动式”减碳。

2022 年 4 月 22 日，四川联合环境交易所联合广州碳排放权交易中心、上海环境能源交易所、北京绿色交易所等共 9 家国家级碳排放权交易平台共同启动“碳普惠共同机制”，并发布《碳普惠共同机制宣言》。

2022 年 4 月 19 日，农业农村部办公厅、国家乡村振兴局综合司联合印发《社会资本投资农业农村指引（2022 年）》，明确要引导好、保护好、发挥好社会资本投资农业农村的积极性、主动性，推动社会资本更好发挥服务全面推进乡村振兴、加快农业农村现代化的作用。

2022 年 4 月 20 日，广州期货交易所官网正式上线运行，广期所两年期品种计划获中国证监会

会批准，明确将 16 个期货品种交由广期所研发上市，包括碳排放权、电力等事关国民经济基础领域和能源价格改革的重大战略品种等共 16 个品种。

国内资讯

2022 年 4 月 20 日，证监会副主席方星海出席博鳌亚洲论坛 2022 年年会“构建可持续发展的 ESG”会议时表示，国际可持续发展准则委员会（ISSB）计划年底出台一套 ESG 披露准则，很可能被全球采用。目前已经在国际上征求意见，预计年底颁布。

2022 年 4 月 21 日，中国 ESG 领导者组织秘书处在线举办了 2022 年首场 ESG 主题沙龙活动。本次沙龙聚焦“ESG 如何赋能企业可持续发展”主题，邀请了 ESG 领域资深专家与理事会成员企业代表出席，共同探讨企业如何更好实现 ESG 可持续发展。

2022 年 4 月 26 日，湖北省内首场绿色电力交易签约仪式在武汉举行，来自省内的 7 家发电企业、8 家电力用户代表签署绿色电力交易协议，并获颁由湖北电力交易中心、湖北碳排放权交易中心共同认证的“绿色电力交易凭证”，标志着电碳协同迈出实质性的关键一步。

2022 年 4 月 29 日，国家开发银行一季度发放绿色贷款 1973 亿元，持续加大对清洁能源、绿色城乡建设、绿色交通建设、工业领域节能环保改造、山水林田湖草沙一体化保护和修复、环境基础设施建设和污染防治等重点项目支持力度。

2022 年 5 月 7 日，工信部等 6 部门公布 2021 年度国家绿色数据中心名单，包括通信、互联网、能源、金融等领域 44 家数据中心入选。至此，我国已先后创建三批共计 153 家国家绿色数据中心。

2022 年 5 月 11 日，秩鼎 ESG 评级正式登陆新浪财经 ESG 评级中心，新浪财经成为国内首家授权展示秩鼎 ESG 数据的财经平台，至此，新浪财经已上线国内外九家权威机构的 ESG 评级，投资者可根据不同需求免费查询。

2022 年 5 月 13 日，金砖国家应对气候变化高级别会议以视频方式举行，并发布金砖国家应对气候变化高级别会议联合声明。

国际消息

2022 年 4 月 22 日，在第 53 个国际地球母亲日，联合国秘书长安东尼奥·古特雷斯国际地球母亲日发表视频致辞，并强调为了保持 1.5 度，各国政府必须在 2030 年前减少 45% 的排放，并在 2050 年前实现碳中和。

2022 年 4 月 24 日，瑞典宣布将把消费排放纳入国家减排责任。迄今为止还没有其他任何国家做出这样的承诺——这意味着在海外制造并进口到瑞典的商品碳排放将被添加到该国的总排放量中。

2022 年 4 月 25 日，通用已经要求其全球供应商签署一份碳中和承诺书，并在其供应链运营中实施可持续采购。

2022 年 5 月 4 日，斯坦福大学官网上发布消息称收到了该校历史上最大的一笔捐款——11 亿美元，用于建设斯坦福杜尔可持续发展学院。这将是斯坦福大学 70 年来第一所新设学院，其初衷是加速解决全球气候危机，专注于应对全球人类所面临的可持续发展的挑战。

2022年5月5日，日本已经告知国际海事组织，将支持征收碳税从2025到2030年，航运业的碳税为每吨二氧化碳付56美元，预计每年近10亿吨的排放量可筹集超过500亿美元。

2022年5月10日，非营利组织 Sustainable Trading 宣布有11家金融服务机构加入成为其成员公司。包括美国资本集团、花旗、富达国际、高盛资产管理在内的11家金融服务机构集体承诺在自己的业务中推动积极的ESG变革，以此来推动整个行业的发展。

2022年5月14日，数字支付平台公司 Stripe 牵头与 Shopify、麦肯锡、脸书、谷歌等企业共同发起了总额9.25亿美元的碳移除 Frontier 基金项目，承诺2022-2030年使用该笔资金用于购买碳移除产生的减排量。