

（三）ESG 相关指数（国内部分）

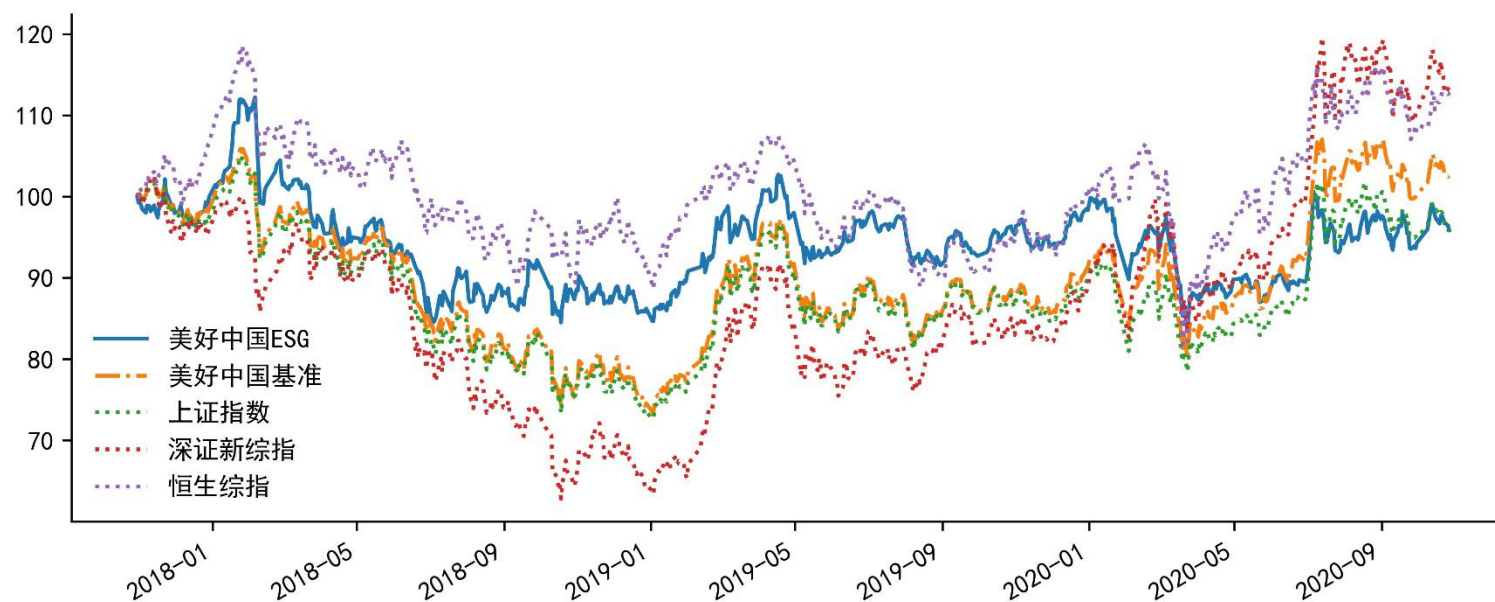
表 1 ESG 相关指数列表（国内部分）

指数名称	指数简称	指数英文名称	指数英文简称
美好中国 ESG100 指数	美好中国 ESG	Beautiful China ESG 100 Index	Beautiful China ESG
中证中财沪深 100ESG 领先指数	ESG 领先	CSI CUFESH-SZ 100 ESG Leading Index	ESG Leading
中证中财沪深 100ESG 领先全收益指数	ESG 领先全收益	CSI CUFESH-SZ 100 ESG Leading TRI Index	ESG Leading TRI
沪深 300 绿色领先股票指数	绿色领先	CSI 300 Green Leading Stock Index	Green Leading
沪深 300 绿色领先股票全收益指数	绿色领先全收益	CSI 300 Green Leading Stock TRI Index	Green Leading TRI
中财-国证深港通绿色优选指数	深港通绿色优选	CUFE-CNISZ-HK Connect Green Selection Index	CUFE-CNISZHKC Green
中财-国证深港通绿色优选收益指数	深港通绿色优选 R	CUFE-CNISZ-HK Connect Green Selection Index R	CUFE-CNISZHKC Green R
中财-国证深港通绿色优选指数（港币）	深港通绿色优选（港币）	CUFE-CNISZ-HK Connect Green Selection Index (HKD)	CUFE-CNISZHKC Green (HKD)
中财-国证深港通绿色优选收益指数（港币）	深港通绿色优选 R（港币）	CUFE-CNISZ-HK Connect Green Selection Index R (HKD)	CUFE-CNISZHKC Green R (HKD)
中证中财苏农苏州绿色发展指数	苏州绿色发展	CSI CUFESZRCB Suzhou Green Development Index	Suzhou Green Development
中证中财苏农苏州绿色发展全收益指数	苏州绿色发展全收益	CSI CUFESZRCB Suzhou Green Development TRI Index	Suzhou Green Development TRI
中证中财苏农长三角 ESG 债券指数	中证中财苏农长三角 ESG 债券	CSI CUFESZRCB Yangtze River Delta ESG Bond Index	Yangtze River Delta ESG Bond
中证中财苏农长三角 ESG 债券指数（净价）	中证中财苏农长三角 ESG 债券（净）	CSI CUFESZRCB Yangtze River Delta ESG Bond Index (Clean Price)	Yangtze River Delta ESG Bond (CP)

资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院整理

1. 美好中国 ESG100 指数

图1 美好中国 ESG100 指数与基准的历史净值 (2017/10/27 -2020/10/27)



资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

表2 美好中国 ESG100 指数与基准的指数绩效 (%) (2020/10/27)

指数	阶段收益	年化收益
----	------	------

	1 个月	3 个月	1 年	年初至今	3 年
美好中国 ESG	2.08	2.97	(0.50)	(3.98)	(1.39)
美好中国基准*	2.76	2.97	15.85	10.76	0.85
上证综指	1.14	1.53	9.20	5.48	(1.36)
深证综指	4.16	3.44	33.78	25.49	4.40
恒生综指	3.83	3.85	18.51	10.92	3.98

资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

表 3 美好中国 ESG100 指数与基准的风险收益特征 (2017/10/27 -2020/10/27)

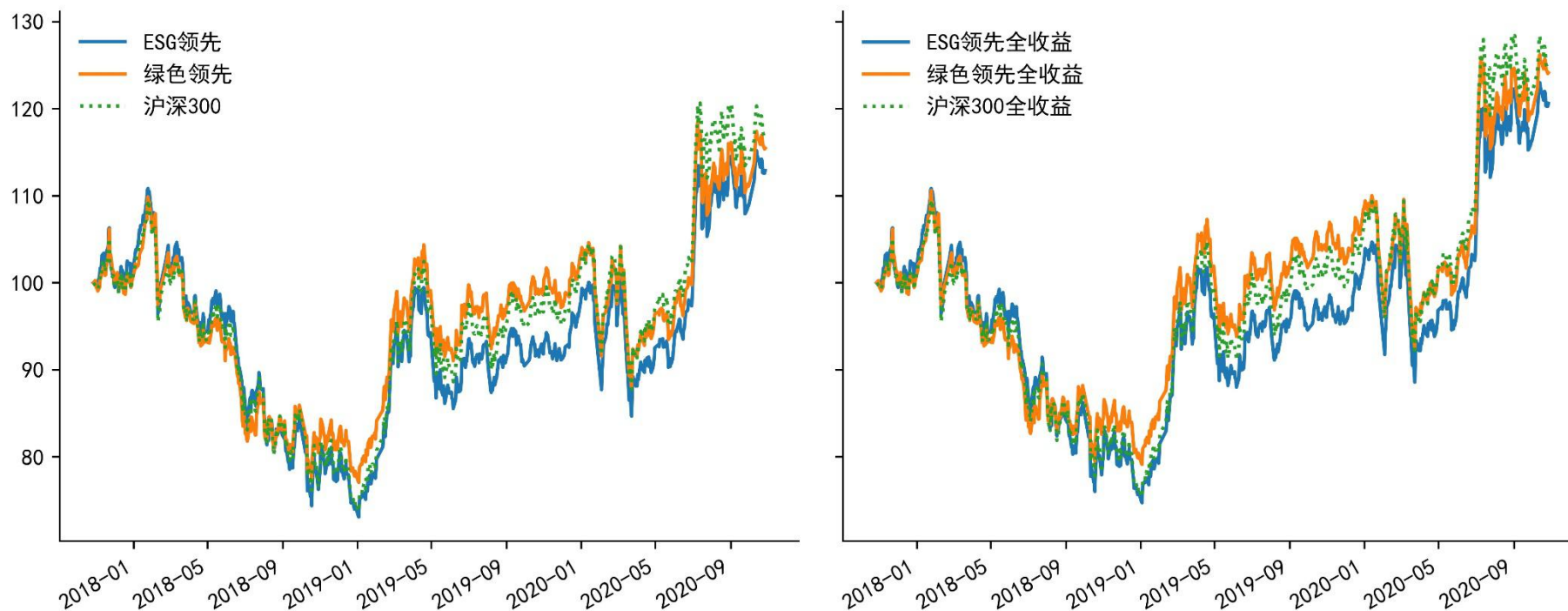
指数	α (%)	β	跟踪误差 (%)	年化标准差 (%)		夏普比率		信息比率		最大回撤		
	3 年	3 年	3 年	1 年	3 年	1 年	3 年	1 年	3 年	幅度 (%)	开始日期	结束日期
美好中国 ESG	(2.25)	0.81	8.63	18.13	17.32	(0.04)	(0.13)	(1.98)	(0.29)	25.57	2018/2/5	2020/3/23
美好中国基准	0.00	1.00	0.00	20.53	19.21	0.79	0.00	0.00	0.00	30.70	2018/1/24	2019/1/3

资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

* 美好中国基准指数由上证综指、深证综指及恒生综指以流通市值加权而成（三个权重分别为美好中国三个交易所成分股流通市值占总流通市值的比重）

2. 中证中财沪深 100ESG 领先指数、沪深 300 绿色领先股票指数

图2 中证中财沪深 100ESG 领先指数、沪深 300 绿色领先股票指数与基准的历史净值 (2017/10/27 -2020/10/27)



资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

表4 中证中财沪深 100ESG 领先指数、沪深 300 绿色领先股票指数与基准的指数绩效 (%) (2020/10/27)

指数	阶段收益	年化收益
----	------	------

	1 个月	3 个月	1 年	年初至今	3 年
ESG 领先	4.07	6.32	21.45	13.63	4.13
绿色领先	3.73	6.64	16.32	10.98	4.91
沪深 300	2.56	3.77	19.68	13.17	5.32
ESG 领先全收益	4.11	6.70	24.06	16.05	6.45
绿色领先全收益	3.75	7.05	18.93	13.46	7.48
沪深 300 全收益	2.58	4.04	22.15	15.49	7.63

资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

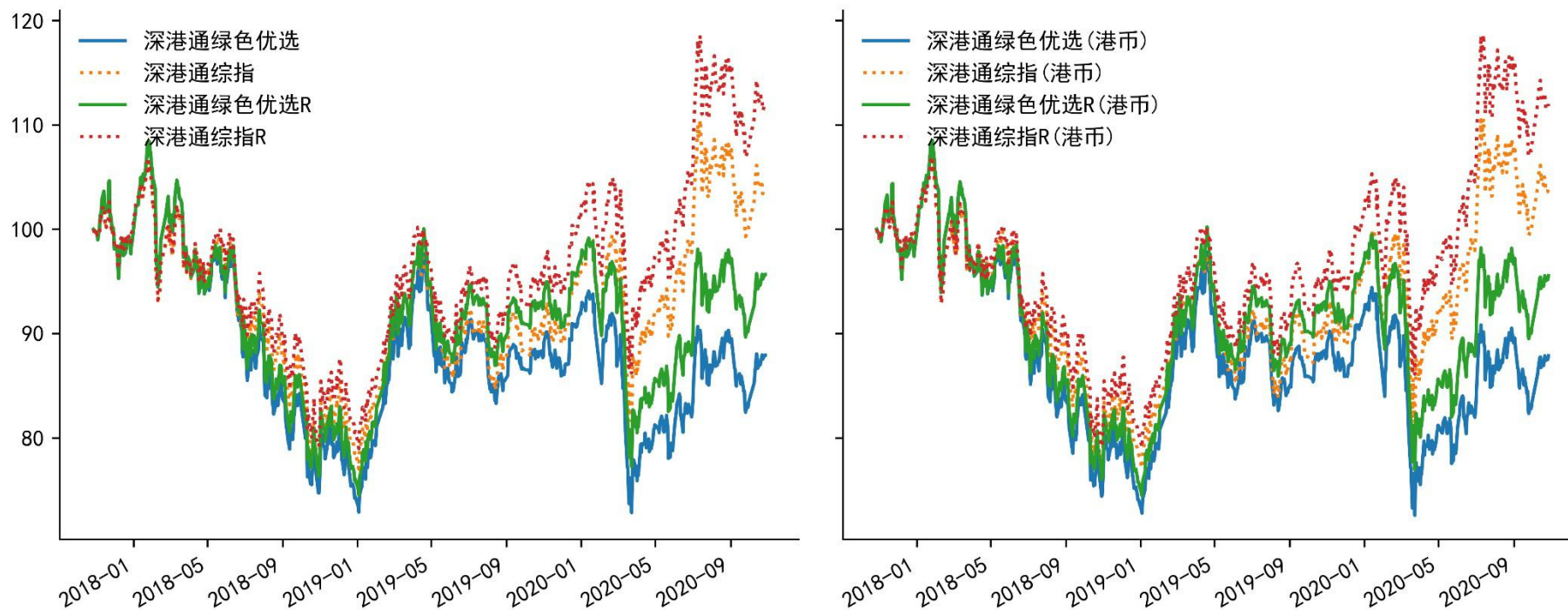
表 5 中证中财沪深 100ESG 领先指数、沪深 300 绿色领先股票指数与基准的风险收益特征（2017/10/27 -2020/10/27）

指数	α (%)	β	跟踪误差 (%)	年化标准差 (%)		夏普比率		信息比率		最大回撤		
	3 年	3 年	3 年	1 年	3 年	1 年	3 年	1 年	3 年	幅度 (%)	开始日期	结束日期
ESG 领先	(1.18)	1.00	3.01	22.20	21.62	0.96	0.20	0.59	(0.39)	34.05	2018/1/24	2019/1/3
绿色领先	(0.23)	0.94	4.58	22.20	20.49	0.74	0.24	(0.74)	(0.05)	29.87	2018/1/24	2019/1/3
沪深 300	0.00	1.00	0.00	22.41	21.38	0.89	0.25	0.00	0.00	32.46	2018/1/24	2019/1/3
ESG 领先全收益	(1.15)	1.00	2.96	22.19	21.62	1.06	0.30	0.64	(0.39)	32.58	2018/1/24	2019/1/3
绿色领先全收益	0.16	0.94	4.52	22.17	20.52	0.84	0.36	(0.69)	0.04	28.46	2018/1/24	2019/1/3
沪深 300 全收益	0.00	1.00	0.00	22.41	21.39	0.98	0.36	0.00	0.00	30.95	2018/1/24	2019/1/3

资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

3. 中财-国证深港通绿色优选指数

图3 中财-国证深港通绿色优选指数与基准的历史净值 (2017/10/27 -2020/10/27)



资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

表6 中财-国证深港通绿色优选指数与基准的指数绩效 (%) (2020/10/27)

指数	阶段收益	年化收益
----	------	------

	1 个月	3 个月	1 年	年初至今	3 年
深港通绿色优选	5.58	3.39	(0.47)	(5.43)	(4.19)
深港通综指	4.09	0.80	14.18	6.55	1.26
深港通绿色优选 R	5.61	3.91	2.79	(2.40)	(1.47)
深港通综指 R	4.13	1.10	16.72	8.83	3.80
深港通绿色优选 (港币)	5.59	3.40	(0.56)	(5.30)	(4.21)
深港通综指 (港币)	4.11	0.81	14.08	6.70	1.33
深港通绿色优选 R (港币)	5.63	3.92	2.69	(2.27)	(1.50)
深港通综指 R (港币)	4.14	1.11	16.61	8.98	3.86

资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

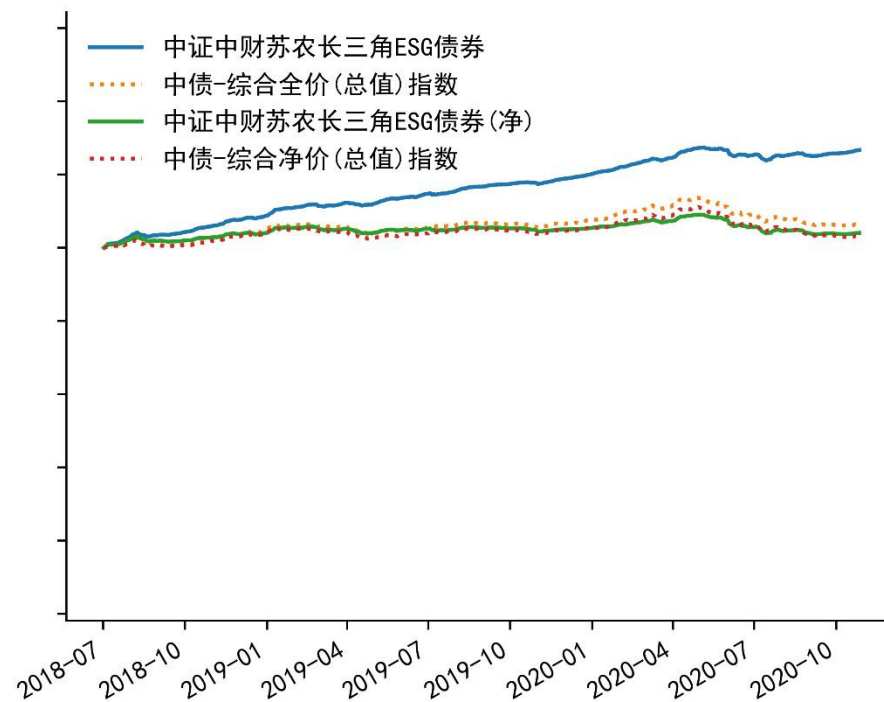
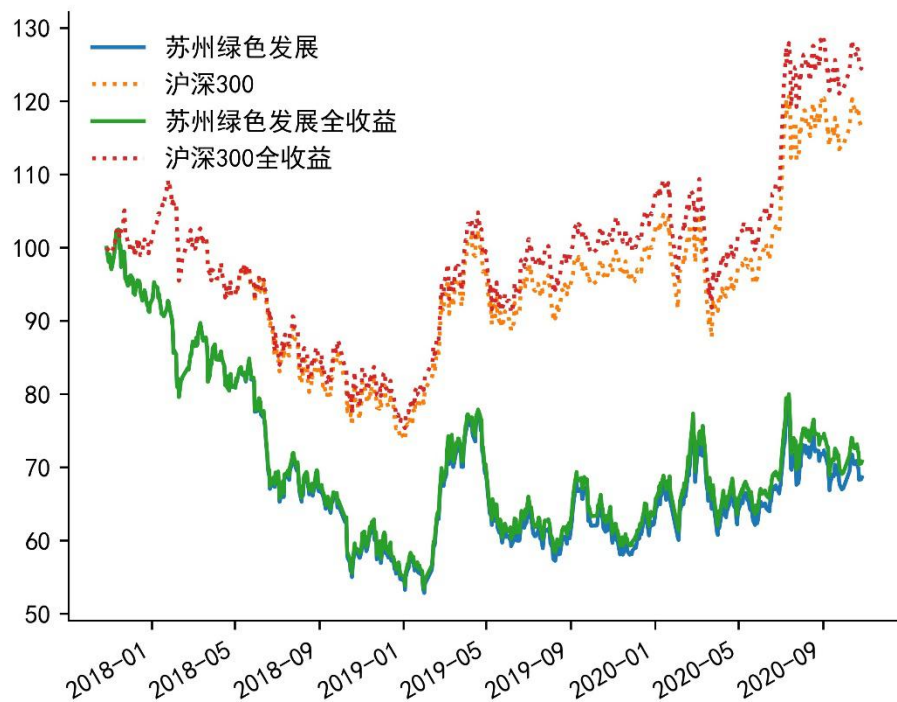
表 7 中财-国证深港通绿色优选指数与基准的风险收益特征 (2017/10/27 -2020/10/27)

指数	α (%)	β	跟踪误差 (%)	年化标准差 (%)		夏普比率		信息比率		最大回撤		
	3 年	3 年	3 年	1 年	3 年	1 年	3 年	1 年	3 年	幅度 (%)	开始日期	结束日期
深港通绿色优选	(5.59)	0.99	5.76	20.74	20.14	(0.08)	(0.20)	(2.82)	(0.97)	32.78	2018/1/26	2020/3/23
深港通综指	0.00	1.00	0.00	21.95	19.53	0.66	0.08	0.00	0.00	27.90	2018/1/24	2019/1/3
深港通绿色优选 R	(5.06)	0.99	5.74	20.84	20.18	0.11	(0.05)	(2.50)	(0.88)	31.26	2018/1/26	2019/1/3
深港通综指 R	0.00	1.00	0.00	22.01	19.55	0.77	0.21	0.00	0.00	26.11	2018/1/24	2019/1/3
深港通绿色优选 (港币)	(5.67)	0.99	5.75	22.65	21.00	0.14	(0.21)	(2.76)	(0.99)	33.09	2018/1/26	2020/3/23
深港通综指 (港币)	0.00	1.00	0.00	23.75	20.30	0.81	0.06	0.00	0.00	27.65	2018/1/24	2019/1/3
深港通绿色优选 R (港币)	(5.16)	1.00	5.73	22.75	21.04	0.31	(0.06)	(2.45)	(0.90)	31.41	2018/1/26	2019/1/3
深港通综指 R (港币)	0.00	1.00	0.00	23.81	20.32	0.91	0.19	0.00	0.00	25.85	2018/1/24	2019/1/3

资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

4. 中证中财苏农苏州绿色发展指数、中证中财苏农长三角 ESG 债券指数

图 4 中证中财苏农苏州绿色发展指数、中证中财苏农长三角 ESG 债券指数与基准的历史净值 (2017/10/27 -2020/10/27)



资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

表 8 中证中财苏农苏州绿色发展指数、中证中财苏农长三角 ESG 债券指数与基准的指数绩效 (%) (2020/10/27)

指数	阶段收益				年化收益
	1 个月	3 个月	1 年	年初至今	3 年

苏州绿色发展	2.48	1.07	8.48	6.58	(11.79)
沪深 300	2.56	3.77	19.68	13.17	5.32
苏州绿色发展全收益	2.48	1.07	9.54	7.63	(10.87)
沪深 300 全收益	2.58	4.04	22.15	15.49	7.63
中证中财苏农长三角 ESG 债券	0.40	0.65	4.08	2.95	
中债-综合全价(总值)指数	0.07	(0.93)	0.31	(0.55)	1.57
中证中财苏农长三角 ESG 债券(净)	0.07	(0.42)	(0.43)	(0.68)	
中债-综合净价(总值)指数	(0.04)	(1.12)	(0.35)	(0.99)	0.86

资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind

表 9 中证中财苏农苏州绿色发展指数、中证中财苏农长三角 ESG 债券指数与基准的风险收益特征 (2017/10/27 -2020/10/27)

指数	α (%)		β	跟踪误差 (%)	年化标准差 (%)		夏普比率		信息比率		最大回撤	
	3 年	3 年	3 年	3 年	1 年	3 年	1 年	3 年	1 年	3 年	幅度 (%)	开始日期
苏州绿色发展	(17.65)	1.05	16.67	28.97	27.92	0.44	(0.43)	(0.44)	(1.06)	48.44	2017/11/13	2019/1/31
沪深 300	0.00	1.00	0.00	22.41	21.38	0.89	0.25	0.00	0.00	32.46	2018/1/24	2019/1/3
苏州绿色发展全收益	(18.93)	1.05	16.68	28.99	27.94	0.48	(0.39)	(0.50)	(1.14)	47.88	2017/11/13	2019/1/31
沪深 300 全收益	0.00	1.00	0.00	22.41	21.39	0.98	0.36	0.00	0.00	30.95	2018/1/24	2019/1/3
中证中财苏农长三角 ESG 债券	3.69	0.47	0.93	1.02	0.89	2.04	3.66	4.16	5.28	1.55	2020/5/6	2020/7/14
中债-综合全价(总值)指数	0.00	1.00	0.00	1.44	1.16	(1.32)	(0.84)	0.00	0.00	3.57	2020/4/29	2020/10/16
中证中财苏农长三角 ESG 债券(净)	(0.74)	0.45	0.92	0.97	0.85	(2.62)	(1.73)	(1.98)	(1.12)	2.55	2020/4/30	2020/9/8
中债-综合净价(总值)指数	0.00	1.00	0.00	1.46	1.17	(1.73)	(1.42)	0.00	0.00	3.92	2020/4/29	2020/10/16

资料来源：中央财经大学绿色金融国际研究院，Wind