

# 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数月度运行报告

2022 年 07 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（2016/1/4-2022/7/18）

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 07 月 18 日可以获得 159.1 元，相较于同一条件下投资上证综指所获得的 99.4 元、投资深证新指数所获得的 109.6 元以及投资恒生综指所获得的 106.9 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（2022/7/18）

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	-1.85	1.01	-16.94	-11.65	4.3
上证综指	-1.17	2.58	-7.38	-9.34	4.16
深证新指数	2.72	8.48	-9.42	-11.8	12.38
恒生综指	-1.58	-3.95	-28.1	-13.32	-6.08

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%。

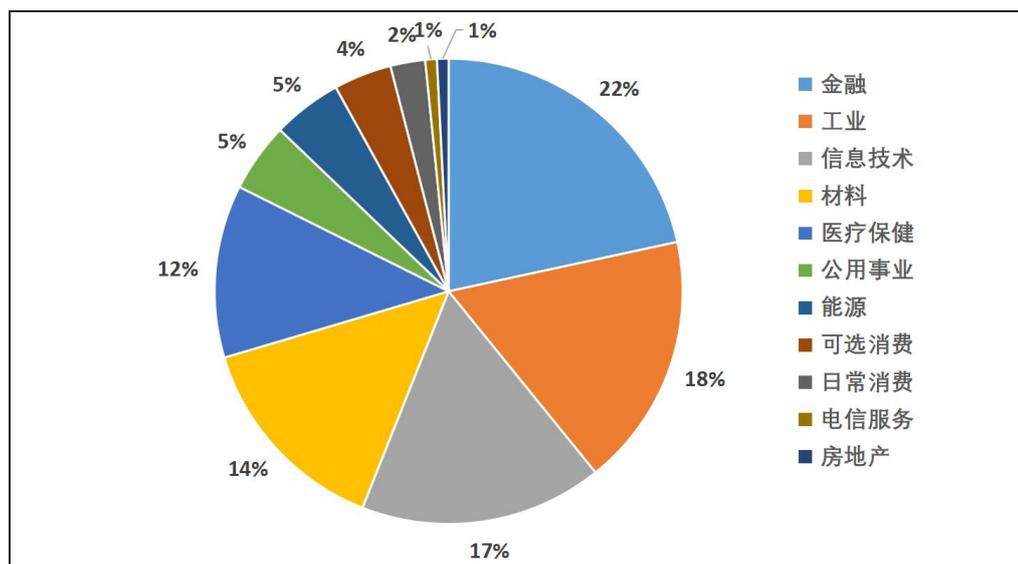


图 2 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数成分股行业权重 (2022/07/18)

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 (2022/07/18)

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
600036.SH	招商银行	-6.70%	5880	8.68%	金融
601012.SH	隆基股份	2.05%	4708	6.95%	信息技术
601318.SH	中国平安	-4.59%	4707	6.95%	金融
002594.SZ	比亚迪	-0.27%	3667	5.42%	可选消费
603259.SH	药明康德	7.37%	2644	3.90%	医疗保健
000001.SZ	平安银行	-7.34%	2598	3.84%	金融
600887.SH	伊利股份	-5.85%	2307	3.41%	日常消费
600900.SH	长江电力	5.72%	2270	3.35%	公用事业
002415.SZ	海康威视	-7.64%	1806	2.67%	信息技术
600309.SH	万华化学	-3.14%	1736	2.56%	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 06 月 18 日至 2022 年 07 月 18 日的近一个月期间，涨幅排名第一名阳光电源 (300274.SZ)，跌幅第一名为沪电股份 (002463.SZ)。



图 3 碧桂园·沪深 ESG100 优选指数成分股市场表现排名（2022/06/18-2022/07/18）

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 23 日，国务院发布《关于加强数字政府建设的指导意见》。《意见》指出，推动绿色低碳转型。加快构建碳排放智能监测和动态核算体系，推动形成集约节约、循环高效、普惠共享的绿色低碳发展新格局，服务保障碳达峰、碳中和目标顺利实现。

2022 年 6 月 28 日，生态环境部、国家发展改革委、自然资源部、水利部四部门联合印发《黄河流域生态环境保护规划》，明确了黄河流域生态环境保护的指导思想、基本原则、主要任务、重点工程和保障措施。

2022 年 6 月 29 日，农业农村部和国家发改委共同制定并发布了《农业农村减排固碳实施方案》，明确了农业农村领域减排固碳的总体思路、基本原则和到 2025 年及 2030 年的主要目标，还提出了今后在种植业节能减排等 6 项重点任务以及可再生能源替代等 10 项重大行动。

2022 年 7 月 12 日，国家发展改革委发布关于印发《“十四五”新型城镇化实施方案》的通知。方案提出推进生产生活低碳化，到 2025 年城市新能源公交车辆占比提高到 72%，在 60 个左右大中城市率先建设完善的废旧物资循环利用体系。

2022 年 6 月 20 日，北京市生态环境局组织编制了《北京市生态环境局关于在建设项目环境影响评价中试行开展碳排放影响评价的通知》（征求意见稿）。据了解，此次意见稿中，全行业碳排放管控是北京市现阶段碳排放管理的重心。

### 国内资讯

2022 年 6 月 21 日，经中国政府、联合国《生物多样性公约》秘书处、加拿大政府协商，联合国《生物多样性公约》缔约方大会第十五次会议（COP15）主席团决定，COP15 第二阶段会议将于 2022 年 12 月 5-17 日在《生物多样性公约》秘书处所在地加拿大蒙特利尔举行。

2022 年 6 月 21 日，广州市正式上线了企业碳账户，并发布了国内首份标准化碳信用报告。根据企业碳信用报告，建设银行花都分行、交通银行花都分行分别与拓璞电器、三华科技等企业现场签订了贷款意向协议，意向绿色贷款金额约 1.4 亿元，顺利实现业务落地。

2022年6月22日，上海市十五届人大常委会第四十一次会议表决通过了《上海市浦东新区绿色金融发展若干规定》，为上海绿色金融服务碳达峰碳中和目标提供立法保障，进一步促进“有效市场”和“有为政府”同向发力，双轮驱动协同推进碳达峰碳中和，该规定将于7月1日正式施行。

2022年6月28日，生态环境部应对气候变化司司长李高在ESG全球领导者峰会致辞中指出，中国始终高度重视应对气候变化，实施积极应对气候变化国家战略，应对气候变化工作取得积极进展。

2022年6月28日，中国财政部原部长楼继伟出席ESG全球领导者峰会并表示，互联网信息平台不能只做助贷，平台金融公司要有一定比例的跟贷，需要公共部门发挥更大的作用。

2022年6月28日，全国社会保障基金理事会副理事长陈文辉在ESG全球领导者峰会发言表示，ESG投资应与国家重点战略相结合，建立中国标准可提升我国在国际投资领域的话语权。

2022年7月5日，香港交易所宣布成立香港国际碳市场委员会，首批成员包括多家领先企业及金融机构，与香港交易所共同探索区域碳市场的发展机遇。

2022年7月12日，2022年中国责任投资论坛（China SIF）夏季峰会在线上成功举行。来自国内外的政策制定者、标准制定者、资产所有者、资产管理者、中介机构以及企业和学术界代表共聚一堂，围绕“构建转型金融体系”展开深入讨论。

2022年7月13日，最新发布的2022年《财富》中国500强排行榜显示，碧桂园集团连续第12年上榜，以5230.6亿元人民币的营业收入位列第23名，展现了公司稳健的经营实力。

## 国际消息

2022年6月23日，欧洲议会全体表决通过了碳边境调节机制（CBAM）的“一读”文本，这是针对去年7月欧委会公布的“立法草案”的正式修正意见。

2022年6月26日，欧洲联盟执行委员会（European Commission）今天敦促航空业者加入它推动的零排放航空联盟（Alliance on Zero Emission Aviation），成员包括飞机制造商、航空公司、机场、能源企业及燃料供应方的代表、乘客与环境利益团体，以及监管与认证机关。

2022年6月28日，世界银行集团行长戴维·马尔帕斯出席ESG全球领导者峰会表示，作为重要的对外投资者，特别是在基础设施方面，中国具有很大影响力，可以在其借贷和投资过程中，推动国际ESG标准的采纳。

2022年6月28日，国际货币基金组织（IMF）总裁克里斯塔利娜·格奥尔基耶娃在ESG全球领导者峰会上强调，IMF欢迎中国通过进一步发展绿色债券分类标准、试点新型的信息共享平台、改善企业和金融机构的环境信息披露等措施来完善绿色金融框架。

2022年6月29日，MSCI董事长兼首席执行官亨利·费南德斯在ESG全球领导者峰会上表示，

一个设计周全的碳定价机制将释放市场力量，最大限度地发挥技术、能源效率和可再生能源的潜力。全球碳定价将加速资本再分配和资产重新定价，这对净零革命至关重要。

2022年7月2日，欧洲议会通过了三项气候变化相关的重要草案，分别涉及碳排放交易系统（ETS）的改革、被称为“碳关税”的碳边界调整机制（CBAM）相关规则修正，以及设立社会气候基金（SCF）。上述三项草案是欧盟“Fit for 55”减排战略的重要组成部分。