

国证社会责任指数编制方案

为反映在社会责任履行方面表现良好的沪深北交易所上市公司证券价格变动的趋势，编制国证社会责任指数。

一、 代码与名称

指数名称：国证社会责任指数

指数简称：国证责任

英文名称：CNI CSR Index

英文简称：CNI CSR

指数代码：399369

二、 基日与基点

指数的基日为 2009 年 6 月 30 日，基点为 1000 点。

三、 选样空间

满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证：

1. 非 ST、*ST 证券；
2. 科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年；其他证

- 券上市时间超过 6 个月；
3. 考察期内证券价格无异常波动；
 4. 公司已披露社会责任报告；
 5. 公司在最近一年无重大违背企业社会责任的行为；
 6. 烟草、烈酒等与社会责任理念不符的行业或公司不予考虑。

四、 选样方法

对满足入围标准的证券，根据综合评估入围公司在经济、社会、环境和公司治理等方面的表现，最终选取 100 只证券，构成国证社会责任指数样本。主要根据以下几条原则挑选：

（1）经济指标：主要考量上市公司在为股东创造净利润的基础上，增加公司年内为国家创造的税收、向员工支付的工资、向银行等债权人给付的借款利息等，并计算上述指标与公司净资产比值，最终将计算结果从高到低排序；

（2）社会指标：主要考量上市公司在劳动者权益保护、诚信经营，产品质量与服务等方面的表现；

（3）环境指标：主要考量上市公司在节约能源、资源利用、环境保护等方面的表现；

（4）公司治理指标：主要考量上市公司在股东权利、权利制衡、约束与激励机制、信息披露等方面的表现，上市公司治理综合评分体系中的总评分要超过 70 分；

(5) 最后，综合考虑企业在和谐社区建设以及公益事业中的贡献。

五、 指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则。

六、 样本调整

1. 样本定期调整

指数样本实施年度定期调整，于每年 6 月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本调整方案通常在实施前两周公布。

每次样本调整数量不超过样本总数的 10%。排名在样本数 70% 范围内的非原样本按顺序入选，排名在样本数 130% 范围内的原样本按顺序优先保留。

在确定新入选样本后，在剩余证券中按选样指标从高到低排序选取样本数量 5% 的证券作为备选样本。

2. 样本临时调整

样本出现终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本名单中排序最靠前的证券补足。

样本公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆等情形的处理，同国证 1000 指数。