

## 深证责任、中小责任指数编制方案

为反映深圳证券市场上在社会责任履行方面表现良好的公司股票价格变动的趋势，编制深证企业社会责任和中小企业社会责任指数。

### 一、代码与名称

指数名称：深证责任指数

指数简称：深证责任

英文名称：SZSE CSR Index

英文简称：SZSE CSR

指数代码：399341

指数名称：中小企业社会责任指数

指数简称：中小责任

英文名称：SZSE SME CSR Index

英文简称：SME CSR

指数代码：399651

### 二、基日与基点

指数基日为 2009 年 6 月 30 日，基点为 1000 点。

### 三、选样空间

在深圳证券交易所上市交易且满足下列条件的所有 A 股：

1. 非 ST、\*ST 的股票；
2. 上市时间超过六个月；
3. 考察期内股价无异常波动；
4. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
5. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
6. 公司最近一年在劳动者权益保护、诚信经营、产品质量与服务、节能环保等方面无重大问题；
7. 公司已披露社会责任报告；
8. 公司在上市公司治理综合评分体系中总评分超过 75 分，或者总评分超过 70 分但在履行社会责任方面表现突出。

### 四、选样方法

对满足入围标准的股票，在公司为股东创造的净利润的基础上，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，计算四项总和与公司净资产比值，最后将计算结果从高到低排序。

综合考虑企业在和谐社区建设以及公益事业中的贡献，最终选取 100 只股票，构成深证企业社会责任指数初始样本股。

在原中小企板中选取 50 只股票构成中小企业社会责任

指数初始样本股。

## 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：

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本股权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本股权重调整”。

## 六、样本股调整

### 1. 样本股定期调整

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

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

在确定新入选样本股后，在剩余股票中按选样指标从高到低排序选取样本数量 5% 的股票作为备选样本股。

### 2. 样本股临时调整

样本股出现暂停上市或终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

样本股公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同深证成指。

## 七、样本股权重调整

在定期调整时，中小责任指数设置权重调整因子，使单只样本股在每次定期调整时的权重不超过 10%。深证责任指数成份股不设置上限因子。

权重调整因子每年调整 1 次，于样本股定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本股临时调整时，新进样本股继承被剔除股票在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进股票的权重调整因子。