

深证企业社会责任指数编制方案

(2019 年 2 月)

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指数。深证责任指数包括纯价格指数和全收益指数，纯价格指数通过深交所行情系统发布实时行情数据，全收益指数通过国证指数网发布收盘行情数据。

一、 代码与名称

指数代码：399341

指数简称：深证责任

指数中文名称：深证责任指数

指数英文名称：SZSE CSR PRICE INDEX

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. 有一定上市交易日期，一般为六个月；
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

深证企业社会责任指数的选样方法是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，并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。

五、 指数计算

同深证成份指数。

六、 样本股调整

1. 样本股定期调整

每年调整一次，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。

样本股定期调整方法是先对入围股票进行综合排名，再按下列原则选股：

- (1) 排名在样本数70%范围内的非原成份股按顺序入选；
- (2) 排名在样本数130%范围内的原成份股按顺序优先保留；
- (3) 每次样本股调整数量不超过样本总数的10%。

在确定新入选成份股后，在剩余股票中按综合排名从高到低排序选取样本数量5%的股票作为备选样本股，用于指数样本股定期调整之间的临时调整。

2. 样本股临时调整

(1) 样本股暂停上市的，从暂停上市日起，将相应样本股从指数计算中剔除，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(2) 样本股终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，将相应样本股从指数计算中剔除，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(3) 若样本股公司因重大违规行为（如财务报告重大造假）而可能被暂停或者终止交易的，将依据指数专家委员会的决定将其在指数样本中及时剔除，并选择备选样本股名单中排序最靠前

的股票补足。

(4) 根据公开信息，当深证企业社会责任指数样本股发生违背其社会责任的特殊事件时，将依据指数专家委员会的决定将其在指数样本中及时剔除，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(5) 样本股被交易所实施风险警示 (ST 或*ST) 的，从实施风险警示次月的第二个星期五的下一个交易日起将其从指数样本中剔除，并选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

(6) 样本股公司发生收购、合并、分拆情形的处理，同深证成份指数。

七、 指数的调整计算

同深证成份指数。

八、 指数的发布与管理

同深证成份指数。

九、 免责声明

同深证成份指数。