

上证社会责任指数编制方案

上证社会责任指数从上证公司治理板块中选取社会责任的履行方面表现良好的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映上证公司治理板块上市公司证券的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称：上证社会责任指数

指数简称：责任指数

英文名称：SSE Social Responsibility Index

英文简称：Responsibility Dividend

指数代码：000048

二、指数基日和基点

该指数以 2009 年 6 月 30 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证公司治理板块中披露社会责任报告的上市公司证券

2、选样方法

(1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

(2) 根据上海证券交易所 2008 年 5 月发布的《关于加强上市公司社会责任承担工作的通知》中关于每股社会贡献值的定义，对剩下的证券按照每股社会贡

献值由高到低进行排名，选取排名在前 100 名的证券作为指数样本。

四、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 = Σ (证券价格 \times 调整股本数)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

指数样本每年调整一次，样本调整实施时间为每年 6 月的第二个星期五的下一交易日。每次样本调整比例一般不超过 10%，除非从样本空间中被调出的老样本超过 10%。

2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

当上证社会责任指数样本由于不符合上证公司治理板块申报条件而临时被从上证公司治理板块中剔除，上证社会责任指数也将随之予以剔除；当上证社会责任指数样本在指数运行期间发生违背其社会责任的特殊事件时，将尽快从上证社会责任指数中剔除。