

上证 50AH 优选指数及上证 180AH 优选指数编制方案

上证 50AH 优选指数及上证 180AH 优选指数分别反映上证 50 指数及上证 180 指数使用 AH 价差投资策略的整体表现。

一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码 (人民币)	指数代码 (港元)
上证 50AH 优选指数	上证 50 优选	SSE 50AH Select Index	SSE 50 Select	950090	950091
上证 180AH 优选指数	上证 180 优选	SSE 180AH Select Index	SSE 180 Select	950092	950093

二、指数基日和基点

该指数系列以 2004 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

三、样本选取方法

1、样本空间

上证 50AH 优选指数及上证 180AH 优选指数的样本空间由上证 180 指数样本空间及同时有沪深市场和香港市场上市证券的香港市场证券作为指数样本。

2、选样方法

(1) 指数样本公司

分别同上证 50 指数及上证 180 指数样本公司

(2) 证券类别挑选

(2.1) 对于不含香港市场证券的上证 50AH 优选指数样本，其沪深市场证券为上证 50AH 优选指数的指数样本；对于不含香港市场证券的上证 180AH 优选指数样本，其沪深市场证券为上证 180AH 优选指数样本；

(2.2) 对于含香港市场证券的上证 50AH 优选指数及上证 180AH 优选指数样本公司，沪深市场证券、香港市场证券中价格相对较低的证券类别被选作指数样本。如果指数样本公司经汇率调整后的沪深市场证券价格除以香港市场证券价格的价格比率小于 1.05，则沪深市场证券被选为指数样本；反之，香港市场证券被选为指数样本。

四、指数计算

上证 50AH 优选指数及上证 180AH 优选指数的计算公式为：

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

其中，调整市值 = Σ (证券价格 × 调整股本数 × 权重因子 × 汇率)。汇率、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。权重因子为实施样本类别转换时，转换后的证券类别继承原证券类别权重所使用的计算因子。

五、指数样本和权重调整

1、定期调整

(1) 半年度定期调整

上证 50AH 优选指数及上证 180AH 优选指数每半年调整一次指数样本，调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

(2) 月度指数样本类别转换

上证 50AH 优选指数及上证 180AH 优选指数样本类别转换每月进行一次，转换实施日期为每月第二个周五收盘后。指数样本类别转换以转换实施日前两天

经汇率调整后的沪深市场证券收盘价格除以香港市场证券收盘价格的价格比率作为转换依据。若该价格比率大于 1.05，而指数持有的样本类别为沪深市场证券，样本类别将转换成香港市场证券；若该价格比率小于 1，而指数持有指数样本类别为香港市场证券，样本类别将转换成沪深市场证券；若该价格比率介于 1 和 1.05 之间时，指数样本类别维持不变。月度指数样本类别转换时，权重因子也将进行相应调整。

2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。若上证 50 指数或上证 180 指数样本发生变化，上证 50AH 优选指数及上证 180AH 优选指数样本也做相应调整。