

上证沪港通 AH 溢价指数编制方案

上证沪港通 AH 溢价指数由沪港通范围内同时在沪港两地上市 A 股及 H 股的上市公司的 A 股股票以及 H 股股票组成，以反映沪港两地同时有 A 股及 H 股上市公司群体的两地股票交易折溢价水平。

一、 指数名称和代码

指数名称：上证沪港通 AH 溢价指数

指数简称：沪港 AH 溢价

英文名称：SSE SH-HK AH Premium Index

英文简称：SH-HK AH Premium

指数代码：H50066

二、 指数基日和基点

该指数以 2005 年 1 月 1 日为基日。

三、 样本选取方法

1、 样本空间

上证沪港通 AH 溢价指数的样本空间由所有在上海证券交易所以及香港联合交易所同时有 AH 股的上市公司的 A 股股票以及 H 股股票组成。

2、 选样方法

(1) 若样本空间公司有 A 股被实施风险警示或仅有以人民币交易 H 股，该公司将被剔除出样本空间。

(2) 剩余样本空间内所有公司的 A 股股票以及 H 股股票作为指数样本股。

四、 指数计算

上证沪港通 AH 溢价指数，以上市公司 A 股以及 H 股总自由流通股本为基础，分别以 A 股及 H 股人民币价格计算市值，然后相比，得出 AH 股溢价指数。

指数=（以 A 股价格计算的成分股总调整市值 / 以 H 股价格计算的成分股总调整市值）×100

其中，总调整市值=Σ（股价×总调整股本数×汇率）。总调整股本数为采用分级靠档的方法对成份股股本进行调整后的 A 股股本以及 H 股股本之和。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；汇率采用汤森路透综合汇率报价中间价。

五、 指数样本和权重调整

1、定期调整

上证沪港通 AH 溢价指数的样本股每半年调整一次，样本股调整实施时间分别是每年 6 月和 12 月的第二个星期五收盘后的下一交易日。

2、临时调整

特殊情况下将对上证沪港通 AH 溢价指数进行临时调整。当样本公司不符合样本空间条件或样本公司 A 股被实施特别风险警示时，将及时从样本股中剔除。当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。